

Données corrélées et modèle additif.

Xavier Gendre

► **To cite this version:**

Xavier Gendre. Données corrélées et modèle additif.. Journées MAS et Journée en l'honneur de Jacques Neveu, Aug 2010, Talence, France. <inria-00510302>

HAL Id: inria-00510302

<https://hal.inria.fr/inria-00510302>

Submitted on 17 Aug 2010

HAL is a multi-disciplinary open access archive for the deposit and dissemination of scientific research documents, whether they are published or not. The documents may come from teaching and research institutions in France or abroad, or from public or private research centers.

L'archive ouverte pluridisciplinaire **HAL**, est destinée au dépôt et à la diffusion de documents scientifiques de niveau recherche, publiés ou non, émanant des établissements d'enseignement et de recherche français ou étrangers, des laboratoires publics ou privés.

Journées MAS 2010, Bordeaux

Session : Statistiques et Traitement du Signal

Données corrélées et modèle additif.

par **Xavier Gendre**

Etant donné un vecteur aléatoire Y de moyenne s et de matrice de covariance quelconque et connue à une constante multiplicative σ près, nous proposons d'estimer s par sélection de modèle. Les résultats sont établis sous l'hypothèse d'un bruit gaussien et sous des hypothèses de moment pour σ connue ou inconnue. Nous les appliquons ensuite au cadre de la régression additive afin d'estimer une composante de la fonction de régression.

Adresse :

Xavier GENDRE

Laboratoire d'Analyse, Topologie et Probabilités

Université de Provence, C.M.I.

Technopôle Château-Gombert, 39, rue F. Joliot Curie, 13453 Marseille Cedex 13, France

E-mail : gendre@cmi.univ-mrs.fr

<http://www.latp.univ-mrs.fr/~gendre/>

Session : Statistiques et Traitement du Signal