

Propriétés asymptotiques de l'estimateur du maximum de vraisemblance pour des modèles Markoviens cachés indexés par des arbres binaires.

mardi 11 juin 2024 15:10 (30 minutes)

Dans cet exposé, nous définissons les modèles Markoviens cachés indexés par des arbres binaires, et considérons le cas où ces processus sont caractérisés par un paramètre. Nous étudions l'estimateur du maximum de vraisemblance (EMV) de ce paramètre défini uniquement à partir des variables observées. Nous montrons que l'EMV est fortement consistant et qu'il a des fluctuations asymptotiques distribuées comme une loi Gaussienne dont la matrice de covariance est la matrice d'information de Fisher.

Auteur principal: WEIBEL, Julien (IDP - Orléans et CERMICS - ENPC)

Orateur: WEIBEL, Julien (IDP - Orléans et CERMICS - ENPC)