

Des algorithmes stochastiques pour estimer une fonction de hasard

Mariane Pelletier, Université de Versailles Saint Quentin (France)

Avec l'avènement des données massives, les estimateurs récursifs connaissent un nouvel essor puisqu'ils présentent deux avantages indéniables sur leur version non-réursive : leur mise à jour au fur et à mesure de l'arrivée des données est quasi instantanée et, surtout, elle ne nécessite pas le stockage de l'ensemble des données.

L'objectif de cet exposé est de montrer comment l'utilisation de divers algorithmes stochastiques permet la construction d'estimateurs récursifs d'une fonction de hasard et d'illustrer, au travers de cet exemple, les différentes techniques permettant l'étude des algorithmes stochastiques en statistique non paramétrique.