

PLAN DE COURS
STT 6115 - Théorie de la décision bayésienne
Automne 2010

Objectif

Ce cours introduit les concepts fondamentaux de la théorie de la décision bayésienne. La modélisation de l'information à priori, l'estimation ponctuelle, ainsi que les tests d'hypothèses et les intervalles de confiance seront quelques-uns des sujets abordés. Si le temps nous le permet, nous étudierons également les méthodes de Monte Carlo par chaînes de Markov.

Horaire

Cours: lundi de 11h30 à 12h30, salle 4186
mardi de 13h30 à 15h30, salle 4186

Heures de disponibilité: lundi de 13h à 14h
mardi de 12h30 à 13h30

Evaluation

Devoirs: 30%
Examen intra: 35% (mardi le 19 octobre, de 13h30 à 15h30, salle 4186)
Examen final: 35% (lundi le 13 décembre, de 11h30 à 13h30, salle 4186)

Renseignements généraux

Professeure: Mylène Bédard
Bureau: 4223
Téléphone: 514-343-6111 poste 2727
Courriel: bedard@dms.umontreal.ca
Site Web: www.dms.umontreal.ca/~bedard

Livre du cours (fortement recommandé)

Robert, Christian P. (1994). *The Bayesian Choice: From Decision-Theoretic Foundations to Computational Implementation, 2nd edition*. Springer-Verlag, New York.

Autres références

Berger, James O. (1985). *Statistical Decision Theory and Bayesian Analysis, 2nd edition*. Springer-Verlag, New York.

Schervish, Mark J. (1996). *Theory of Statistics*. Springer-Verlag, New York.