

Densités de probabilité de statistiques d'ordre d'entropie maximale

Cristina Butucea

Nous étudions la densité de probabilité d'un vecteur ordonné presque sûrement et d'entropie maximale. Après avoir calculé la copule d'un tel vecteur, nous en déduisons la formule explicite de la densité de probabilité associée à des lois marginales données (et compatibles avec la contrainte d'ordre p.s.). Cette densité a une forme produit sur son support et nous proposons des estimateurs non paramétriques qui exploitent la structure de ce modèle et atteignent la vitesse uni-dimensionnelle associée à la marginale la moins régulière. Ce travail est joint avec J.-F. Delmas, A. Dutfoy et R. Fischer.