Statistiques	DEMI2E
Gubinelli Massimiliano	Polycopié 4 - v.1 20110318

Estimation ponctuelle

Modèle paramétrique

On observe un échantillon $(X_1, ..., X_n)$ où les X_j sont des v.a. i.i.d.. On parle d'un modèle paramétrique si la loi commune des X_j appartient à une famille paramètre $\mathcal{P} = \{\mathbb{P}_\theta, \theta \in \Theta\}$.

Exemple 1. Modèle de Bernoulli: $\mathcal{P} = \{\mathcal{B}(p), p \in [0,1]\}$, $\theta = p$, $\Theta = [0,1]$.

Modèle Uniforme: $\mathcal{P} = \{\mathcal{U}([0,\theta]), \theta \in \Theta = \mathbb{R}_+ \backslash \{0\}\}$.

Modèle Gaussien: $\mathcal{P} = \{\mathcal{N}(\mu, \sigma^2), \mu \in \mathbb{R}, \sigma^2 \in \mathbb{R}_+ \backslash \{0\}\}$, $\theta = (\mu, \sigma^2)$, $\Theta = \mathbb{R} \times (\mathbb{R}_+ \backslash \{0\})$

Notations.

- $\mathbb{P}_\theta(X \in A)$: probabilité que $X \in A$ lorsque X suit $\mathbb{P}_\theta$.
- $\mathbb{E}_\theta[h(X)]$: Espérance de $h(X)$ lorsque X suit $\mathbb{P}_\theta$.
- Si X est une v.a. discrète, i.e. X est à valeurs dans un ensemble au plus dénombrable $X \in \{1, 2, ...\}$ on note $\mathbb{P}_\theta(X = x) = p(x, \theta)$.
- Si X est une v.a. continue alors on notera $f(x, \theta)$ la densité de X selon $\mathbb{P}_\theta$.
- Soit $X = (X_1, ..., X_n)$ un échantillon de taille n où les X_j sont i.i.d.

  1. *Dans le cas discret:* $\mathbb{P}_\theta(X = x) = p(x, \theta) = \prod_{j=1}^n p(x_j, \theta)$
  2. *Dans le cas continu:* $f(x, \theta) = \prod_{j=1}^n f(x_j, \theta)$

  ou $x = (x_1, ..., x_n)$ est la réalisation de l'échantillon $X = (X_1, ..., X_n)$.

Exemple 2. Dans le modèle de Bernoulli $(X_1, ..., X_n)$ un échantillon de n v.a. i.i.d. $\sim \mathcal{B}(p)$, où $p \in [0,1]$,

$$p(x, p) = \prod_{j=1}^n p(x_j, p) = \prod_{j=1}^n [p^{x_j}(1-p)^{1-x_j}] = p^{\sum_{j=1}^n x_j}(1-p)^{n - \sum_{j=1}^n x_j}.$$

Dans le modèle Gaussien

$$f(x, \mu, \sigma^2) = \prod_{j=1}^n f(x, \mu, \sigma^2) = \frac{1}{(2\pi\sigma^2)^{n/2}} e^{-\frac{1}{2\sigma^2}\sum_{j=1}^n (x_j - \mu)^2}$$

Définition 3. *On appelle statistique toute v.a. S qui dépend de l'échantillon $(X_1, ..., X_n)$ mais qui ne fait pas intervenir le paramètre θ.*

Exemple 4. Quelques statistiques:

- $\sum_{j=1}^n X_j$

- $\overline{X}_n$ (la moyenne empirique)

- $\max_{1 \leqslant j \leqslant n}(X_j)$

- $\frac{1}{n}\sum_{j=1}^{n}(X_j - \overline{X}_n)^2$ (variance empirique)

Mais θX_1 et $(\overline{X}_n + \theta^2 \max_{1 \leqslant j \leqslant n}(X_j))$ ne sont pas des statistique.

Estimation ponctuelle

Définition 5. *Soit g une application sur Θ. On appelle estimateur (ponctuel) de $g(\theta)$ toute statistique T prenant ses valeurs dans $g(\Theta)$.*

Exemple 6. Dans le modèle de Bernoulli $\mathcal{P} = \{\mathcal{B}(p), p \in [0,1]\}$ la moyenne empirique $\overline{X}_n$ est un estimateur de p ($g(p) = p$ c-à-d g est l'identité sur $\Theta = [0,1]$).

Dans le modèle Gaussien $\mathcal{P} = \{\mathcal{N}(\mu, \sigma^2), (\mu, \sigma^2) \in \mathbb{R} \times \mathbb{R}_+^*\}$ la variance empirique

$$S_n^2 = \frac{1}{n}\sum_{j=1}^{n}(X_j - \overline{X}_n)^2$$

est un estimateur de σ^2 ($g(\mu, \sigma^2) = \sigma^2$) et $S_n = \sqrt{S_n^2}$ (l'écart-type empirique) est un estimateur de σ (l'écart-type théorique).

Quelques propriétés des estimateurs

Définition 7. *Un estimateur T de $g(\theta)$ est dit sans biais (ou non biaisé) si $\mathbb{E}_\theta[T] = g(\theta)$. Autrement, le biais $b(\theta) = \mathbb{E}_\theta[T] - g(\theta) = 0$.*

Définition 8. *On appelle risque quadratique d'un estimateur T, et on note $R(T,\theta)$ la quantité $R(T,\theta) = \mathbb{E}_\theta[(T - g(\theta))^2]$. En particulier, si T est sans biais alors $R(T,\theta) = \mathbb{E}_\theta[(T - \mathbb{E}_\theta[T])^2] = \mathrm{Var}_\theta(T)$.*

Remarque 9. On peut toujours écrire

$$R(T,\theta) = \mathrm{Var}_\theta(T) + (b(\theta))^2$$

donc dans le risque il y a une partie due à la variance de la statistique et un autre du à son biais. En effet

$$\begin{aligned}
R(T,\theta) &= \mathbb{E}_\theta[(T - g(\theta))^2] = \mathbb{E}_\theta[((T - \mathbb{E}_\theta[T]) + (\mathbb{E}_\theta[T] - g(\theta)))^2] \\
&= \mathbb{E}_\theta[(T - \mathbb{E}_\theta[T])^2 + 2(\mathbb{E}_\theta[T] - g(\theta))(T - \mathbb{E}_\theta[T]) + (\mathbb{E}_\theta[T] - g(\theta))^2] \\
&= \mathbb{E}_\theta[(T - \mathbb{E}_\theta[T])^2] + 2b(\theta)\mathbb{E}_\theta[T - \mathbb{E}_\theta[T]] + (b(\theta))^2 \\
&= \mathrm{Var}_\theta(T) + (b(\theta))^2
\end{aligned}$$

Définition 10. *Soient T_1 et T_2 deux estimateurs non biaises de $g(\theta)$. On dira que T_2 est plus efficace de T_1 si $R(T_2,\theta) \leqslant R(T_1,\theta)$ pour tout $\theta \in \Theta$, c-à-d $\mathrm{Var}_\theta(T_2) \leqslant \mathrm{Var}_\theta(T_1)$ pour tout $\theta \in \Theta$.*

Exemple 11. Reprenons l'exemple du modèle de Bernoulli $\mathcal{P} = \{\mathcal{B}(p), p \in [0,1]\}$. Comparons les estimateurs X_1 et $\overline{X}_n$ (Il s'agit d'estimer le paramètre p).

$\mathbb{E}[X_1] = p$ donc X_1 est un estimateur non biaisé de p.

$\mathbb{E}[\overline{X}_n] = p \Rightarrow \overline{X}_n$ est aussi un estimateur non biaisé de p.

$R(X_1, p) = \mathrm{Var}_p(X_1) = p(1-p)$

$R(\overline{X}_n, p) = \mathrm{Var}_p(\overline{X}_n) = (\mathrm{Var}_p(X_1) + \cdots + \mathrm{Var}_p(X_n))/n^2 = p(1-p)/n$

On en déduit que $\mathrm{Var}_p(\overline{X}_n) \leqslant \mathrm{Var}_p(X_1)$ pour tout $p \in [0,1]$ donc $\overline{X}_n$ est un estimateur plus efficace que X_1.

Exemple 12. Modèle Uniforme. $\mathcal{P} = \{\mathcal{U}([0,\theta]), \theta \in \mathbb{R}_+^*\}$, $f(x,\theta) = \theta^{-1}\mathbb{I}_{x \in [0,\theta]}$. On considère les estimateurs suivants: $T_1 = 2\,\overline{X}_n$ et $T_2 = [(n+1)/n]\max_{1 \leqslant j \leqslant n} X_j$.

On observe un échantillon de taille n. Montrons que ces estimateurs sont non biaises:

$\mathbb{E}_\theta[2\overline{X}_n] = 2\,\mathbb{E}_\theta[X_1] = 2\frac{\theta}{2} = \theta$ (non biaisé)

On pose $Y = \max_{1 \leqslant j \leqslant n} X_j$. Soit $y \in \mathbb{R}$,

$$\mathbb{P}_\theta(Y \leqslant y) = \mathbb{P}_\theta(X_1 \leqslant y, \ldots, X_n \leqslant y) = \mathbb{P}_\theta(X_1 \leqslant y)^n = \begin{cases} 0 & \text{si } y \leqslant 0 \\ (y/\theta)^n & \text{si } y \in [0,\theta] \\ 1 & \text{si } y > \theta \end{cases}$$

Donc Y admet pour densité la fonction $g(y,\theta)$ donnée par

$$g(y,\theta) = \frac{n}{\theta^n} y^{n-1} \mathbb{I}_{0 \leqslant y \leqslant \theta}$$

et

$$\mathbb{E}_\theta[Y] = \int_0^\theta \frac{n}{\theta^n} y^n \mathrm{d}y = \frac{n}{n+1}\theta$$

ce qui donne

$$\mathbb{E}_\theta[T_2] = \frac{n+1}{n}\mathbb{E}_\theta[Y] = \theta$$

et par conséquence T_2 est un estimateur non biaisé de θ. Calculons les variances respectives de T_1 et T_2:

$$\mathrm{Var}_\theta(T_1) = 4\mathrm{Var}_\theta(\overline{X}_n) = \frac{4}{n}\mathrm{Var}_\theta(X_1) = \frac{\theta^2}{3n}$$

et

$$\mathrm{Var}_\theta(T_2) = \left(\frac{n+1}{n}\right)^2 \mathrm{Var}_\theta(Y) = \left(\frac{n+1}{n}\right)^2 \left[\mathbb{E}_\theta[Y^2] - \left(\frac{n}{n+1}\right)^2 \theta^2\right]$$

Or

$$\mathbb{E}_\theta[Y^2] = \int_0^\theta \frac{n}{\theta^n} y^{n+1} \mathrm{d}y = \frac{n}{n+2}\theta^2$$

donc

$$\mathrm{Var}_\theta(T_2) = \left(\frac{n+1}{n}\right)^2 \left[\frac{n}{n+2} - \left(\frac{n}{n+1}\right)^2\right]\theta^2 = \frac{\theta^2}{n(n+2)}$$

et

$$\frac{\mathrm{Var}_\theta(T_2)}{\mathrm{Var}_\theta(T_1)} = \frac{3}{n+2} \leqslant 1$$

qui montre que T_2 est plus efficace que T_1.

Définition 13. *Soit l'application* $g: \Theta \to \mathbb{R}^d$. *On dit que la suite* $(T_n)_{n \geqslant 1}$ *d'estimateurs de* $g(\theta)$ *est*

1. *Convergente: si* $(T_n)_{n \geqslant 1}$ *converge en probabilité vers* $g(\theta)$ *pour tout* $\theta \in \Theta$.
2. *Fortement convergente: si* $(T_n)_{n \geqslant 1}$ *converge presque sûrement vers* $g(\theta)$ *pour tout* $\theta \in \Theta$.
3. *Asymptotiquement normale: si pour tout* $\theta \in \Theta$ *existe une matrice de covariance* $\Sigma(\theta)$ *telle que* $\sqrt{n}(T_n - g(\theta)) \xrightarrow{\mathcal{L}} \mathcal{N}_d(0, \Sigma(\theta))$.

Exemple 14. Soient $X_1, ..., X_n$ un échantillon de loi $\mathcal{B}(p)$. D'après la loi forte des grandes nombres

$$\overline{X}_n \xrightarrow{p.s.} p \qquad \text{pour tout } p \in [0,1]$$

la suite $(X_n)_{n \geqslant 1}$ est fortement convergente. De plus $\mathrm{Var}_p(X_1) = p(1-p) < +\infty$ et d'après le TCL

$$\sqrt{n}(\overline{X}_n - p) \xrightarrow{\mathcal{L}} \mathcal{N}(0, p(1-p))$$

la suite $(X_n)_{n \geqslant 1}$ est asymptotiquement normale avec $\Sigma(p) = p(1-p)$.

Exhaustivité

Définition 15. *Une statistique* S *est dite exhaustive si la loi conditionnelle de* $X = (X_1, ..., X_n)$ *sachant* $S = s$ *ne dépends pas du paramètre* θ *pour tout* s.

Théorème 16. *(De factorisation)* S *est une statistique exhaustive ssi il existe des applications* g *et* h *telles que*

$$p(\boldsymbol{x}, \theta) = g(\boldsymbol{x})\, h(S(\boldsymbol{x}), \theta) \ \text{ dans le cas discret}$$

$$f(\boldsymbol{x}, \theta) = g(\boldsymbol{x}) h(S(\boldsymbol{x}), \theta) \text{ dans le cas continu}$$

Rappel. $p(\boldsymbol{x}, \theta) = \prod_{j=1}^n p(x_j, \theta)$ et $f(\boldsymbol{x}, \theta) = \prod_{j=1}^n f(x_j, \theta)$

Démonstration. (Uniquement dans le cas discret). ($\Rightarrow$) Supposons que S est exhaustive. $p(\boldsymbol{x}, \theta) = \mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x}) = \mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x} \text{ et } S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\ )$ car $\{S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\} \supseteq \{\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x}\}$. Donc $\mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x}) = \mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x} \mid S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\ ) \mathbb{P}_\theta(\ S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\ )$. Or S est exhaustive $\Rightarrow \mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x} \mid S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\ )$ ne dépends pas de θ: $\mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x} \mid S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\ ) = \mathbb{P}(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x} \mid S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\ )$ et on pose $g(\boldsymbol{x}) = \mathbb{P}(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x} \mid S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\ )$ et $h(s, \theta) = \mathbb{P}_\theta(\ S(\boldsymbol{X}) = s\ )$. Il vient que

$$p(\boldsymbol{x}, \theta) = \mathbb{P}(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x} \mid S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\ ) \mathbb{P}_\theta(\ S(\boldsymbol{X}) = S(\boldsymbol{x})\ ) = g(\boldsymbol{x})\, h(S(\boldsymbol{x}), \theta).$$

($\Leftarrow$) Réciproquement, supposons qu'il existe g et h telles que

$$p(\boldsymbol{x}, \theta) = g(\boldsymbol{x})\, h(S(\boldsymbol{x}), \theta)$$

et montrons que S est exhaustive. Fixons s. On pose $A_s = \{\boldsymbol{y} : S(\boldsymbol{y}) = s\}$.

$$\mathbb{P}_\theta(S(\boldsymbol{X}) = s) = \sum_{\boldsymbol{x} \in A_s} \mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x}) = \sum_{\boldsymbol{x} \in A_s} g(\boldsymbol{x})\, h(S(\boldsymbol{x}), \theta) = h(s, \theta) \sum_{\boldsymbol{x} \in A_s} g(\boldsymbol{x})$$

$$\mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x} | S(\boldsymbol{X}) = s) = \frac{\mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x}, S(\boldsymbol{X}) = s)}{\mathbb{P}_\theta(S(\boldsymbol{X}) = s)} = \begin{cases} 0 & \text{si } s \neq S(\boldsymbol{x}) \\ \frac{\mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x})}{\mathbb{P}_\theta(S(\boldsymbol{X}) = s)} & \text{si } s = S(\boldsymbol{x}) \end{cases}$$

Si $s = S(\boldsymbol{x})$

$$\frac{\mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x})}{\mathbb{P}_\theta(S(\boldsymbol{X}) = s)} = \frac{g(\boldsymbol{x})\, h(s, \theta)}{h(s, \theta) \sum_{\boldsymbol{x} \in A_s} g(\boldsymbol{x})} = \frac{g(\boldsymbol{x})}{\sum_{\boldsymbol{x} \in A_s} g(\boldsymbol{x})}$$

donc

$$\mathbb{P}_\theta(\boldsymbol{X} = \boldsymbol{x} | S(\boldsymbol{X}) = s) = \begin{cases} 0 & \text{si } s \neq S(\boldsymbol{x}) \\ \frac{g(\boldsymbol{x})}{\sum_{\boldsymbol{x} \in A_s} g(\boldsymbol{x})} & \text{si } s = S(\boldsymbol{x}) \end{cases}$$

qui ne dépends pas de θ et qui donne l'exhaustivité de S. $\square$

Exemple 17. Soit $\boldsymbol{X} = (X_1, ..., X_n)$ un échantillon de Bernoulli de paramètre p et $S(\boldsymbol{X}) = \sum_{j=1}^n X_j$. Montrons que S est exhaustive pour p.

$$p(\boldsymbol{x}, \theta) = \prod_{j=1}^n p^{x_j} (1-p)^{1-x_j} = p^{\sum_{j=1}^n x_j} (1-p)^{n - \sum_{j=1}^n x_j} = g(\boldsymbol{x})\, h(S(\boldsymbol{x}), p)$$

avec $g(\boldsymbol{x}) = 1$ et $h(s, p) = p^s (1-p)^{n-s}$. Par le théorème de factorisation on en déduit que S est exhaustive pour p.

Exemple 18. Soit $\boldsymbol{X} = (X_1, ..., X_n)$ un échantillon Gaussien de moyenne μ et variance σ^2. On pose

$$S(\boldsymbol{X}) = (\sum_{j=1}^n X_j, \sum_{j=1}^n X_j^2).$$

Montrons que S est exhaustive pour (μ, σ^2):

$$f(\boldsymbol{x}, \theta) = \frac{1}{(2\pi\sigma^2)^{n/2}} e^{-\frac{1}{2\sigma^2} \sum_{j=1}^n (x_j - \mu)^2} = \frac{1}{(2\pi\sigma^2)^{n/2}} e^{-\frac{1}{2\sigma^2} \sum_{j=1}^n (x_j^2 - 2\mu x_j + \mu^2)}$$

$$= \frac{1}{(2\pi\sigma^2)^{n/2}} e^{-\frac{1}{2\sigma^2} (\sum_{j=1}^n x_j^2 - 2\mu \sum_{j=1}^n x_j + n\mu^2)} = g(\boldsymbol{x})\, h(S(\boldsymbol{X}), (\mu, \sigma^2))$$

où $g(\boldsymbol{x}) = 1$ et

$$h((s_1, s_2), (\mu, \sigma^2)) = \frac{1}{(2\pi\sigma^2)^{n/2}} e^{-\frac{1}{2\sigma^2}(s_2 - 2\mu s_1 + n\mu^2)}$$

Par le théorème de factorisation on en déduit que S est exhaustive pour (μ, σ^2).

Méthodes d'estimation

Méthode des moments

Définition 19. *Soit $r \in \mathbb{N}^*$. Si X est une v.a. réelle t.a. $\mathbb{E}[|X|^r] < +\infty$ alors on appelle $\mathbb{E}[X^r]$ le moment d'ordre r de X et on le note m_r.*

Définition 20. *On appelle moment empirique d'ordre r la statistique*

$$\frac{1}{n} \sum_{j=1}^n (X_j)^r$$

que on notera $M_{r,n}$.

Exemple 21. $M_{1,n} = \overline{X_n}$ et $M_{2,n} = n^{-1}\sum_{j=1}^n X_j^2$.

Définition 22. *Soit $\theta = (\theta_1, \ldots, \theta_d) \in \Theta \subseteq \mathbb{R}^d$. On suppose que X est une v.a. réelle telle que $\mathbb{E}[|X|^d] < +\infty$. S'il existe des applications $\varphi_1, \ldots, \varphi_d$ telles que $\theta_j = \varphi_j(m_1, m_2, \ldots, m_d)$, alors l'estimateur obtenu par la méthode des moments est donnée par*

$$\hat{\theta}_n = (\varphi_1(M_{1,n}, \ldots, M_{d,n}), \ldots, \varphi_d(M_{1,n}, \ldots, M_{d,n})).$$

Exemple 23. $X \sim \mathcal{P}(\lambda)$, $\lambda > 0$. $\lambda = \mathbb{E}[X] = m_1$. L'estimateur de λ obtenu par la méthode des moments est

$$\hat{\lambda}_n = M_{1,n} = \overline{X_n}.$$

Exemple 24. $X \sim \mathcal{N}(\mu, \sigma^2)$. $\mu = \mathbb{E}[X] = m_1$ et $\sigma^2 = \mathrm{Var}(X) = \mathbb{E}[X^2] - (\mathbb{E}[X])^2 = m_2 - m_1^2$. L'estimateur de $\theta = (\mu, \sigma^2)$ obtenu par la méthode des moments est $\hat{\theta_n} = (\hat{\mu}_n, \hat{\sigma}_n^2)$ où $\hat{\mu}_n = M_{1,n} = \overline{X_n}$ et $\hat{\sigma}_n^2 = M_{2,n} - M_{1,n}^2$:

$$\hat{\sigma}_n^2 = M_{2,n} - M_{1,n}^2 = \frac{1}{n}\sum_{j=1}^n X_j^2 - \overline{X}_n^2 = \frac{1}{n}\sum_{j=1}^n (X_j - \overline{X}_n)^2 = S_n^2$$

la variance empirique.

Méthode de maximum de vraisemblance

Définition 25. *Soit $\boldsymbol{x} = (x_1, \ldots, x_n)$ une réalisation d'un échantillon $\boldsymbol{X} = (X_1, \ldots, X_n)$ de n v.a. iid. La fonction $L_n(\boldsymbol{x}, \theta)$ (ou $L_n(\theta)$) donnée par*

- $L_n(\theta) = L_n(\boldsymbol{x}, \theta) = p(\boldsymbol{x}, \theta) = \prod_{j=1}^n p(x_j, \theta)$ *dans le cas discret*

- $L_n(\theta) = L_n(\boldsymbol{x}, \theta) = f(\boldsymbol{x}, \theta) = \prod_{j=1}^n f(x_j, \theta)$ *dans le cas continu*

vue comme fonction de θ pour $\boldsymbol{x}$ fixé, s'appelle la vraisemblance de la réalisation $\boldsymbol{x} = (x_1, \ldots, x_n)$.

Définition 26. *On suppose que pour toute réalisation $\boldsymbol{x} = (x_1, \ldots, x_n)$ il existe une unique valeur $\hat{\theta}_n(\boldsymbol{x})$ qui maximise la vraisemblance $L_n(\boldsymbol{x}, \theta)$. Alors la statistique $\hat{\theta}_n(\boldsymbol{X})$ est appelée l'estimateur de maximum de vraisemblance (EMV) du paramètre θ. Il revient au même de maximiser la vraisemblance ou son logarithme, c-à-d la log-vraisemblance, souvent notée $\ell_n(\theta)$ ou $\ell_n(\boldsymbol{x}, \theta)$, i.e.*

$$\ell_n(\boldsymbol{x}, \theta) = \ell_n(\theta) = \log L_n(\theta) = \begin{cases} \sum_{j=1}^n \log(p(x_j, \theta)) & \text{dans le cas discret ;} \\ \sum_{j=1}^n \log(f(x_j, \theta)) & \text{dans le cas continu .} \end{cases}$$

Remarque 27. Pour chercher l'EMV, on cherchera les solutions de l'équation

$$\left(\frac{\partial \ell_n}{\partial \theta_1}, \ldots, \frac{\partial \ell_n}{\partial \theta_d}\right) = (0, \ldots, 0)$$

et vérifier que la matrice Hessienne

$$\left(\frac{\partial^2 \ell_n}{\partial \theta_i \partial \theta_j}\right)_{i,j=1,\ldots,d}$$

est définie négative (on a supposé que $\theta \mapsto \ell_n(\theta)$ est $C^2(\Theta)$).

Exemple 28. Soit $\boldsymbol{X} = (X_1, ..., X_n)$ un échantillon Bernoulli de paramètre $p \in [0, 1]$.

$$L_n(\boldsymbol{x}, p) = p^{\sum_{j=1}^n x_j}(1-p)^{n - \sum_{j=1}^n x_j}$$

$$\ell_n(\boldsymbol{x}, p) = \sum_{j=1}^n x_j \log(p) + \left(n - \sum_{j=1}^n x_j\right) \log(1-p)$$

$$\frac{\partial \ell_n(\boldsymbol{x}, p)}{\partial p} = \sum_{j=1}^n x_j \frac{1}{p} - \left(n - \sum_{j=1}^n x_j\right) \frac{1}{1-p}$$

$$\frac{\partial \ell_n(\boldsymbol{x}, p)}{\partial p} = 0 \Longleftrightarrow \sum_{j=1}^n x_j \frac{1}{p} - \left(n - \sum_{j=1}^n x_j\right) \frac{1}{1-p} = 0$$

qui donne:

$$p = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n x_j$$

Donc $\frac{\partial \ell_n(\boldsymbol{x}, p)}{\partial p} = 0$ admet unique solution $\hat{p}_n = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n x_j = \overline{x}_n$ et

$$\frac{\partial^2 \ell_n(\boldsymbol{x}, p)}{\partial p^2} = -\sum_{j=1}^n x_j \frac{1}{p^2} - \left(n - \sum_{j=1}^n x_j\right) \frac{1}{(1-p)^2} < 0$$

ce qu'implique que $\hat{p}_n$ est un maximum globale de $p \mapsto \ell_n(\boldsymbol{x}, p)$ et que l'EMV de p est $\overline{X}_n$.