

Pourquoi l'approche minimax n'est pas si pessimiste

En statistiques non paramétriques, l'approche minimax est considérée comme un bon cadre pour déterminer les performances d'un estimateur. Cette théorie est basée sur la recherche du "pire taux d'approximation" sur un espace fonctionnel donné. Dans cet exposé nous montrons que dans les espaces de Besov et pour certaines familles d'estimateurs, cette recherche du pire cas donne en réalité un taux d'approximation générique, au sens de la prévalence. Dans un second temps, nous regardons aussi le lien entre la vitesse d'approximation générique et le formalisme multifractal.