
PHILIPPE GAGNON, Université de Montréal

Inférence robuste sur les paramètres d'une régression linéaire simple bayésienne

En statistique, et en particulier dans un cadre de régression linéaire, il arrive fréquemment qu'un échantillon de données contienne des valeurs aberrantes. Conséquemment, l'inférence statistique peut être contaminée par leur présence, menant ainsi à des résultats qui sont en désaccord avec la majorité des observations. La méthode de régression des moindres carrés est certes la plus populaire, mais elle peut mener à une inférence non robuste face à ces valeurs aberrantes. Cette présentation traite de régression linéaire simple paramétrique et bayésienne. Des résultats théoriques garantissant la robustesse de l'inférence *a posteriori* face à des valeurs aberrantes sont expliqués.