

## **ANALYSE SÉQUENTIELLE (G7, H2, I2, I4, L3, M3)**

(27 / 07 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) L'**analyse séquentielle** (cf **théorie séquentielle**) est une approche consistant à appliquer une méthode statistique de façon répétée jusqu'à ce qu'une condition, en principe fixée au départ, soit réalisée (cf aussi **jeu statistique séquentiel**). Cette condition peut être :

(a) la **précision** d'un **estimateur** (cf **estimation séquentielle, estimation séquentielle de la densité**) ;

(b) le résultat d'un **test d'hypothèses** données à l'avance (cf aussi **test séquentiel** de WALD, **test des rangs séquentiels**).

(ii) Le cadre statistique de base est celui du **problème de décision séquentielle** (cf aussi **schéma séquentiel fermé**).

(iii) Divers concepts, tels celui des rapports de **vraisemblance** successifs, peuvent permettre de déterminer la taille d'**échantillon** optimale.