

CÔNE DE CONFIANCE (H2)

(26 / 05 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

On appelle parfois **cône de confiance** une **région de confiance** particulière, qui concerne principalement un **paramètre** de **centralité** d'une **loi directionnelle** (cf **paramètre de position**).

En effet, par définition, une **variable aléatoire** directionnelle prend des valeurs orientées sur une **sphère** de \mathbf{R}^K (eg sphère de rayon 1) et ces valeurs sont plus ou moins réparties autour d'une **valeur centrale** : un **estimateur ensembliste** naturel de celle-ci peut donc être un **cône** de sommet $0 \in \mathbf{R}^K$, dont les droites génératrices s'appuient sur une « coupole » de la sphère. La probabilité de cette coupole n'est autre que le **coefficient de confiance** $1 - \alpha$, fixé a priori, de l'**intervalle de confiance** correspondant à l'estimateur ensembliste.