

Estimation non paramétrique

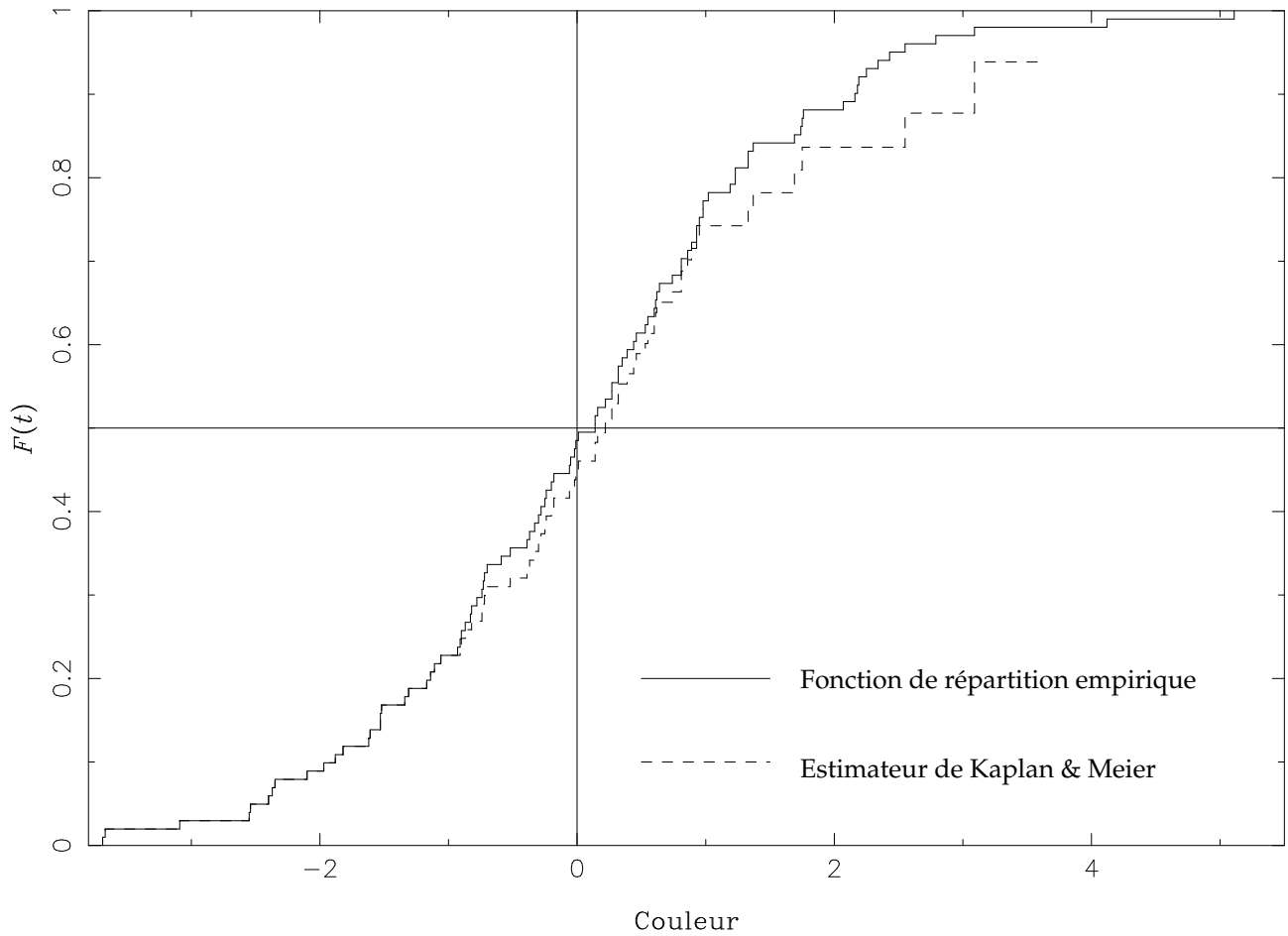


Figure 1. Estimation non paramétrique (Kaplan & Meier) de la fonction de répartition.

La fonction de répartition empirique (ici connue, car il s'agit d'une simulation) est également représentée.

La médiane de l'estimateur de Kaplan & Meier vaut $\hat{m} = 0,22$; la moyenne (sous-estimée car le dernier point est censuré) est $\hat{\mu} = 0,26$.

Estimation paramétrique

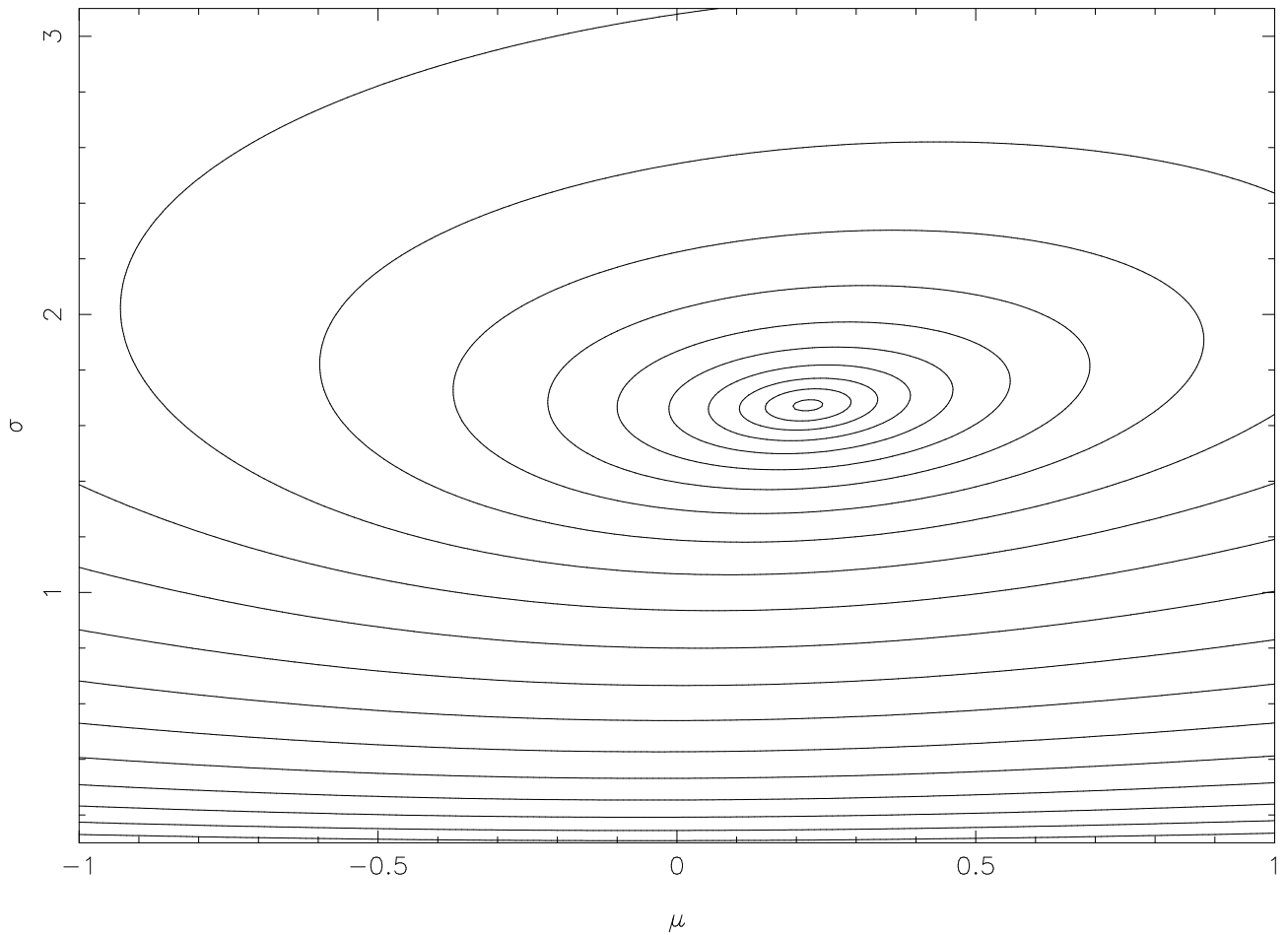


Figure 2. Courbes d'égle vraisemblance pour une loi normale.

Le maximum de vraisemblance est obtenu pour $\hat{\mu} = 0,22$ et $\hat{\sigma} = 1,67$ (la simulation a été effectuée pour une loi normale de moyenne $\mu = 0$ et d'écart-type $\sigma = \sqrt{2}$).