

Détection de rupture en grande dimension avec parcimonie

Farida Enikeeva, INRIA Grenoble

On considère le problème de détection de rupture dans une suite de vecteurs gaussiens en grande dimension. Supposons que la suite présente une rupture en moyenne dans certain nombre de composantes des vecteurs tandis qu'aucune rupture ne survient dans les autres composantes. Le nombre de composantes avec rupture est inconnu. Nous proposons un test adaptatif au nombre de composantes présentant une rupture. Nous démontrons la consistance du test et son optimalité au sens minimax.

Ce travail est issu d'une collaboration avec Zaid Harchaoui.