

---

# Test minimax et adaptatif pour la détection d'une rupture transitoire dans la loi d'un processus de Poisson

Fabrice Grela\*<sup>1</sup>

<sup>1</sup>Institut de Recherche Mathématique de Rennes – Université de Rennes 2 – France

## Résumé

En considérant un processus de Poisson observé sur un intervalle de temps borné et fixé, on s'intéresse au problème de la détection d'une rupture transitoire dans la loi du processus, caractérisée par un segment dans son intensité. Nous formulons ce problème de détection a posteriori comme un problème de tests simples et présentons une étude minimax non asymptotique. Nous établissons ainsi les vitesses de séparation minimax pour la détection d'une rupture transitoire de taille et/ou de longueur et/ou de localisation inconnue(s) et construisons des procédures de tests minimax ou minimax adaptatives.

---

\*Intervenant