

# Keynes' Treatise on Probability Revisited

**Christian ROBERT**

*(Université Paris Dauphine et CREST, LS)*

5 séances de 2 heures

**Site Parisien ENSAE**

(Mars – Avril 2010)

Ce cours est consacré à la relecture du traité de statistique de John Maynard Keynes écrit avant qu'il ne se consacre à l'Economie. Le principe sera le même que celui ayant dirigé le Jeffreys' Theory of Probability Revisited donné en 2006 et 2008 (et qui a conduit à la rédaction d'un article, Robert, Chopin et Rousseau, 2010), à savoir la mise en perspective des principes et des méthodes vis à vis de l'état actuel de la statistique bayésienne. Il ne s'agit pas d'un exercice purement historique, comme l'a montré la relecture de Jeffreys, puisque des méthodes nouvelles peuvent parfois surgir de telles relectures.

*L'évaluation des étudiants inscrits se fera au travers d'un mémoire écrit.*

**Ce cours est ouvert aux élèves de l'ENSAE, de l'ENSAI et aux étudiants de M2, ainsi qu'aux étudiants en thèse.**

## **Bibliographie**

Keynes, J. M. (1921), *A Treatise on Probability*, Dover Publications (réimprimé en 2004).  
Robert, C. P. (2007), *The Bayesian Choice*, Springer Verlag, New York.  
Robert, C. P., Chopin, N. et J. Rousseau (2010), "Harold Jeffreys' Theory of Probability Revisited", *Statistical Science* (to appear, with discussion).