

LOI A PRIORI INVARIANTE (G3)

(07 / 11 / 2019, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2019)

Soit $\{(\mathcal{X}, \mathcal{B}, (P_\theta^X)_{\theta \in \Theta}), D, L\}$ un **problème de décision** statistique, supposé invariant pour un **groupe de transformations** \mathcal{G} défini sur \mathcal{X} (cf **problème invariant**). Soit \mathcal{B}_Θ une **tribu de parties** de Θ et Π une **probabilité a priori** définie sur \mathcal{B}_Θ .

On dit que Π est une **(loi de probabilité) a priori invariante** pour le groupe $\bar{\mathcal{G}}$ (induit par \mathcal{G} sur Θ) ssi :

$$(1) \quad \bar{g}(\Pi) = \Pi \bar{g} = \Pi, \quad \forall \bar{g} \in \bar{\mathcal{G}},$$

ie ssi la mesure Π est invariante par toute **application mesurable** \bar{g} .