

## MESURE DE PROXIMITÉ (DE PITMAN) (H5)

(17 / 06 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) On se place dans le cadre de la notion de **proximité entre estimateurs** (au sens de E.J.G. PITMAN).

On appelle **mesure de proximité (au sens de E.J.G. PITMAN)** entre deux **estimateurs** S et T d'un même **paramètre**  $\theta$  la fonction  $\delta_N$  définie par :

$$(1) \quad (S, T) \mapsto \delta_N(S, T) = P_{\theta} \{ \delta(T, \theta) < \delta(S, \theta) \}.$$

(ii) Dans ce cas, on dit que T est un **estimateur plus proche (au sens de PITMAN)** de  $\theta$  que ne l'est S.

(iii) La notion de proximité précédente :

(a) dépend, en général, de la **métrique**  $\delta$  définie sur l'ensemble des paramètres  $\Theta$  ;

(b) n'est pas transitive : si R, S et T sont des estimateurs de  $\theta$ , R peut être plus proche de  $\theta$  que S, S plus proche de  $\theta$  que T, mais T peut être plus proche de  $\theta$  que R.