

PROBABILITÉ COMPLÈTE (B1, G2)

(29 / 08 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) Soit (Ω, \mathcal{F}, P) un **espace probabilisé** et \mathcal{N} la classe des **parties** P-négligeables de Ω (cf **partie négligeable**), ie :

$$(1) \quad A \in \mathcal{N} \Rightarrow P(A) = 0.$$

On dit que P est une **probabilité complète** sur (ou relativement à) la **tribu** \mathcal{F} ssi \mathcal{F} contient tous les **ensembles** P-négligeables, ie ssi $\mathcal{N} \subset \mathcal{F}$.

(ii) Le concept se transpose directement à une **loi de probabilité** : on parle alors de **loi complète**.

(iii) Si $(\Omega, \mathcal{F}, \mathcal{P})$ désigne un **modèle statistique**, on dit que la **famille** \mathcal{P} des probabilités P définies sur \mathcal{F} est une **famille complète** ssi, $\forall P \in \mathcal{P}$, P est une probabilité complète sur \mathcal{F} .

Cette notion est à distinguer de celle de famille complète de probabilités (cf **famille complète de lois**).