RÉGION DE CONFIANCE SANS BIAIS (H2)

(12 / 06 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

La notion de **règle sans biais** se spécialise en celle de **région de confiance sans biais** (resp de **test sans biais**).

(i) On dit que $S(x)$ est une **région de confiance sans biais de niveau $1 - \alpha$** pour un **paramètre** $\tau = g(\theta)$ ssi :

$$(1) \quad 1 - \alpha = P_{\theta}([S(X) \ni g(\theta)]) \geq P_{\theta}([S(X) \ni g(\theta^{\#})]), \quad \forall (\theta, \theta^{\#}) \in \Theta^2.$$

(ii) On appelle **région de confiance sans biais (uniformément) la plus précise** une région qui est à la fois :

(a) une région de confiance sans biais ;

(b) une région (uniformément) la plus précise, ie la plus concentrée autour de $g(\theta)$ (cf **région de confiance la plus précise**).