

RÈGLE ADMISSIBLE (G4)

(10 / 06 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

(i) Soit $R(m, \theta)$ une **fonction de risque** associée à une **règle de décision (mixte)** $m \in \Delta_M$ et soit \succ le **préordre** strict sur Δ_M associé à R .

On dit que $m \sim$ est une **règle (mixte) admissible** ssi aucune autre règle mixte ne lui est strictement préférable (au sens de \succ), ie ssi :

$$(1) \quad m \in \Delta_M \text{ et } m \prec m \sim \Leftrightarrow m = m \sim,$$

où \prec désigne le préordre strict inverse de \succ (ie $m_1 \prec m_2 \Leftrightarrow m_2 \succ m_1$).

La règle $m \sim$ est donc un élément maximal de l'ensemble Δ_M préordonné par \succ (cf **élément extrémal**).

On note généralement A (ou \mathcal{A}) l'ensemble des règles admissibles déduites d'un risque R .

(ii) La définition précédente vaut aussi pour des **règles pures admissibles** (qui sont des règles mixtes particulières).