Московский физико-технический институт

М А Т Е М А Т И Ч Е С К А Я С Т А Т И С Т И К А

I ЗАДАНИЕ

Автор: Яфаров Руслан,
Б13-202

весна 2024

1. Виды сходимости случайных векторов

1. Пусть $X_1, \ldots, X_n$ — независимые одинаково распределенные случайные величины с распределением $Exp(\alpha)$, $\alpha > 0$.
Рассмотрим статистику $Y = \frac{1}{n}\sum\limits_{i=1}^{n} X_i$. Найдите такие константы $a(\alpha)$ и $\sigma^2(\alpha) > 0$, что выполнено

$$\sqrt{n}(Y \sin Y - a(\alpha)) \xrightarrow{\mathrm{d}} \mathcal{N}(0,\sigma^2(\alpha)), \text{ при } n \to \infty$$

Решение. По закону больших чисел $Y \xrightarrow{d} \frac{1}{\alpha}$. По ЦПТ $\sqrt{n}\left(Y - \frac{1}{\alpha}\right) \xrightarrow{d} \mathcal{N}\left(0, \frac{1}{\alpha^2}\right)$. Воспользуемся теоремой 1.4 из С2. Положим $h(x) = x\sin x, b_n = \frac{1}{\sqrt{n}}, \xi_n = \sqrt{n}\left(Y - \frac{1}{\alpha}\right), a = \frac{1}{\alpha}$. Тогда получим, что $\frac{h(a+\xi_n b_n)-h(a)}{b_n} = \sqrt{n}\left(Y\sin Y - \frac{1}{\alpha}\sin\frac{1}{\alpha}\right) \xrightarrow{d} h'(a)\mathcal{N}\left(0, \frac{1}{\alpha^2}\right) \sim \left(\sin\frac{1}{\alpha} + \frac{1}{\alpha}\cos\frac{1}{\alpha}\right)\mathcal{N}\left(0, \frac{1}{\alpha^2}\right) \sim \mathcal{N}\left(0, \left(\frac{1}{\alpha}\sin\frac{1}{\alpha} + \frac{1}{\alpha^2}\cos\frac{1}{\alpha}\right)^2\right) \Rightarrow a(\alpha) = \frac{1}{\alpha}\sin\frac{1}{\alpha}, \sigma(\alpha) = \frac{1}{\alpha}\sin\frac{1}{\alpha} + \frac{1}{\alpha^2}\cos\frac{1}{\alpha}$

2. Пусть $\{\xi_n\}_{n=1}^{\infty}$,$\{\eta_n\}_{n=1}^{\infty}$,$\{\zeta\}_{n=1}^{\infty}$- последовательности случайных величин. Докажите, что если $\xi_n \xrightarrow{d} \xi$,$|\xi_n - \eta_n| \leq \zeta_n|\xi_n|$, $\zeta_n \xrightarrow{P} 0$, то $\eta_n \xrightarrow{d} \xi$

Решение.

Лемма. Пусть ξ_n, посл-ть случайных величин, $\xi_n \geq 0, \xi_n \xrightarrow{d} \xi$. Тогда

3. Задан набор независимых одинаково распределённых случайных величин $X_1, \ldots, X_n$ с распределением $\mathcal{N}(0,\sigma^2)$. Рассмотрим статистики $Y = \frac{1}{n}\sum\limits_{i=1}^{n}|X_i|$,$Z = \frac{1}{n}\sum\limits_{i=1}^{n}X_i^2$, $T = \sqrt{\frac{2}{\pi}}Z/Y$
Найдите предел сходимости по распределению выражения $\sqrt{n}(T - \sigma)$

Решение. Найдем необходимые моменты и ковариации:

$$\mathbb{E}|X_i| = \int_{\mathbb{R}} |x| p_{X_i}(x)dx = 2\int_0^{+\infty} x\frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}}e^{-\frac{x^2}{2\sigma^2}}dx = \frac{2}{\sqrt{2\pi\sigma^2}}\int_0^{+\infty} -\frac{\sigma^2}{x}xd(e^{-\frac{x^2}{2\sigma^2}}) = \sigma\sqrt{\frac{2}{\pi}}e^{-\frac{x^2}{2\sigma^2}}\Bigg|_{+\infty}^{0}$$

$$= \sigma\sqrt{\frac{2}{\pi}}$$

$$\mathbb{E}X_i^2 = \mathbb{D}X_i + (\mathbb{E}X_i)^2 = \sigma^2$$

$$\mathbb{E}|X_i|X_i^2 = 2\int_0^{+\infty} x^3\frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}}e^{-\frac{x^2}{2\sigma^2}}dx = -2\sigma^2\left(x^2 p_{X_i}(x)\Big|_0^{+\infty} - 2\int_0^{+\infty} xp_{X_i}(x)dx\right) = 2\sigma^2\mathbb{E}|X_i| = 2\sigma^3\sqrt{\frac{2}{\pi}}$$

$$\mathbb{E}X_i^4 = -\sigma^2\left(0 - \int_{\mathbb{R}} p_{X_i}(x)3x^2dx\right) = 3\sigma^2\mathbb{E}X_i^2 = 3\sigma^4$$

$$\mathbb{D}|X_i| = \sigma^2 - \sigma^2\frac{2}{\pi} = \sigma^2\frac{\pi - 2}{\pi}, \mathbb{D}X_i^2 = \mathbb{E}X_i^4 - (\mathbb{E}X_i^2)^2 = 3\sigma^4 - \sigma^4 = 2\sigma^4$$

$$cov(|X_i|, X_i^2) = \mathbb{E}|X_i|X_i^2 - \mathbb{E}|X_i|\mathbb{E}X_i^2 = 2\sigma^3\sqrt{\frac{2}{\pi}} - \sigma\sqrt{\frac{2}{\pi}}\sigma^2 = \sigma^3\sqrt{\frac{2}{\pi}}$$

Положим $\eta_i = (|X_i|, X_i^2)^T$, тогда $\mathbb{D}\eta_i = \begin{pmatrix} \sigma^2\frac{\pi-2}{\pi} & \sigma^3\sqrt{\frac{2}{\pi}} \\ \sigma^3\sqrt{\frac{2}{\pi}} & 2\sigma^4 \end{pmatrix}$ Далее воспользуемся теоремой 1.4 для $\xi_n = \sum_{i=1}^n \eta_i, h(x,y) = \sqrt{\frac{2}{\pi}}\frac{y}{x}, b_n = 1/\sqrt{n}, a = \mathbb{E}\eta_1 = (\sigma\sqrt{\frac{2}{\pi}}, \sigma^2)^T$. Получим

$$\sqrt{n}(T-\sigma) \xrightarrow{d} (\nabla h|_a, \xi) \sim \mathcal{N}\left(0, \nabla h|_a^T \mathbb{D}\eta \nabla h|_a\right)$$

$$\nabla h = (-\sqrt{\frac{2}{\pi}}\frac{y}{x^2}, \sqrt{\frac{2}{\pi}}\frac{1}{x})^T \Rightarrow \nabla h|_a = (-\sqrt{\frac{\pi}{2}}, \frac{1}{\sigma})^T \Rightarrow \nabla h|_a^T \mathbb{D}\eta\nabla h|_a = \sigma^2\left(\frac{\pi}{2}-1\right)$$

4. Пусть ξ,ξ_1,$\xi_2, \dots$ - такие случайные величины, что $(\xi_n - \xi)^2 \xrightarrow{P} 0$ при $n \to \infty$ Показать, что $\xi_n^2 \xrightarrow{P} \xi^2$ при $n \to \infty$

Решение. $(\xi_n-\xi)^2 \xrightarrow{P} 0 \iff P(|\xi_n - \xi|^2 > \varepsilon^2) = P(|\xi_n - \xi| > \varepsilon) \to 0 \Rightarrow \xi_n \xrightarrow{P} \xi$. Далее пользуемся теоремой о наследовании сходимости для $h(x) = x^2$

5. Пусть ξ,ξ_1,$\xi_2, \dots$ - случайные величины. Привести пример, когда

1. $\xi_n \xrightarrow{L_2} \xi$, $\xi_n \overset{\text{п.н.}}{\not\to} \xi$, $n \to \infty$
2. $\xi_n \xrightarrow{\text{п.н}} \xi$, $\xi_n \overset{L_2}{\not\to} \xi$, $n \to \infty$
3. $\xi_n \xrightarrow{d} \xi$, $\xi_n \overset{P}{\not\to} \xi$, $n \to \infty$

Решение. 1.

2.

3. Пусть $\xi \sim \mathcal{N}(0,1), \xi_n = \xi$, тогда $\xi_n \xrightarrow{d} -\xi$, но $P(|\xi_n + \xi| > \varepsilon) = P(|\xi| > \varepsilon/2) \not\to 0$

6. Рассмотрим последовательность d-мерных случайных векторов $\overline{\xi}_n$. Доказать, что если при некотором $\overline{c} \in \mathbb{R}^d$ выполнено соотношение $\overline{\xi}_n \xrightarrow{d} \overline{c}$, то $\overline{\xi}_n \xrightarrow{P} \overline{c}$

Решение. $\overline{\xi}_n \xrightarrow{d} \overline{c} \Rightarrow \xi_n^i \xrightarrow{d} c^i \forall i$. Тогда, если докажем, что $\xi \in \mathbb{R}, \xi \xrightarrow{d} c \in \mathbb{R} \Rightarrow \xi \xrightarrow{P} c$, то утверждение будет доказано, т. к. покомпонентная сх-ть по в-ти влечет сх-ть вектора. Пусть $\xi_n \in \mathbb{R}, \xi_n \xrightarrow{d} c \in \mathbb{R}$. Тогда $P(|\xi_n - c| < \varepsilon) = P(c-\varepsilon < \xi_n < c+\varepsilon) = F_{\xi_n}(c+\varepsilon) - F_{\xi_n}(c-\varepsilon+0) \geq F_{\xi_n}(c+\varepsilon) - F(c-\varepsilon/2) \to 1 \Rightarrow \xi_n \xrightarrow{P} c$

2. Статистики и оценки. Построение и сравнение оценок

7. Пусть $X_1, \dots, X_n$ — выборка из распределения $R(0,\theta)$(равномерного распределения на отрезке $[0,\theta]$). Проверьте на несмещенность, состоятельность и сильную состоятельность следующие оценки параметра $\theta : 2\overline{X}, \overline{X} + X_{(n)}/2, (n+1)X_{(1)}, X_{(1)} + X_{(n)}, \frac{n+1}{n}X_{(n)}$.

Решение.

1. $\mathbb{E}(2\overline{X}) = 2\mathbb{E}X_1 = 2\frac{\theta-0}{2} = \theta \Rightarrow$ оценка несмещенна.
   По УЗБЧ $2\overline{X} \xrightarrow{\text{п. н.}} \theta \Rightarrow$ оценка сильно состоятельна.

2. Пусть $X_{(n)}/2 = \xi_n$. Найдем p_{ξ_n} : $F_{\xi_n}(x) = F^n_{X_1}(2x)$. $p_{\xi_n}(x) = \frac{d}{dx}F_{\xi_n}(x) = nF^{n-1}_{X_1}(2x)p_{X_1}(2x)* 2 = n2^n\frac{x^{n-1}}{\theta^n}I_{[0,\frac{\theta}{2}]}(x)$. $\mathbb{E}\xi_n = \int_0^{\theta/2} xn2^n\frac{x^{n-1}}{\theta^n}dx = n2^n\frac{x^{n+1}}{\theta^n(n+1)}\Big|_0^{\frac{\theta}{2}} = \frac{n}{2n+2}\theta \Rightarrow \mathbb{E}(\overline{X} + X_{(n)}/2) = \frac{\theta}{2}\left(1 + \frac{n}{n+1}\right) \neq \theta \Rightarrow$ оценка является смещенной
   $F_{\xi_n}(x) = \begin{cases} 1, x \geq \theta/2, \\ (\frac{2x}{\theta})^n, 0 < x < \theta/2 \\ 0, x \leq 0 \end{cases}$, тогда при $n \to \infty$ получаем $F(x) = \begin{cases} 1, x \geq \theta/2, \\ 0, x < \theta/2 \end{cases} \Rightarrow$
   $\xi_n \xrightarrow{d} \frac{\theta}{2} \Leftrightarrow \xi_n \xrightarrow{P} \frac{\theta}{2} \Rightarrow$ по теореме о наследовании сходимости получаем, что $\overline{X} + \xi_n \xrightarrow{P} \theta \Rightarrow$ оценка состоятельная

3. Найдем $p_{(n+1)X_{(1)}}$: $F_{X_{(1)}}(x) = 1 - (1 - F_{X_1}(x))^n \Rightarrow F_{(n+1)X_{(1)}}(x) = 1 - (1 - F_{X_1}(\frac{x}{n+1}))^n \Rightarrow$
   $p_{(n+1)X_{(1)}}(x) = n\left(1 - \frac{x}{(n+1)\theta}\right)^{n-1}\frac{1}{\theta}I_{[0,(n+1)\theta]}(x)$
   $\mathbb{E}X_{(1)} = \int_0^\theta xn\left(1 - \frac{x}{\theta}\right)^{n-1}\frac{1}{\theta}dx = \theta n\int_0^1 t(1-t)^{n-1}dt = \theta nB(2,n) = \theta n\frac{\Gamma(2)\Gamma(n)}{\Gamma(n+2)} = \theta n\frac{1!(n-1)!}{(n+1)!} = \frac{\theta}{n+1} \Rightarrow$ оценка $X_{(1)}(n+1)$ несмещенная.
   $F_{(n+1)X_{(1)}}(x) = \begin{cases} 1, x \geq (n+1)\theta, \\ 1 - \left(1 - \frac{x}{(n+1)\theta}\right)^n, 0 < x < (n+1)\theta \\ 0, x \leq 0 \end{cases}$ при $n \to \infty$ получим $F(x) = \begin{cases} 1 - e^{-\frac{x}{\theta}}, x \geq 0, \\ 0, x < 0 \end{cases} \Rightarrow$ оценка не состоятельна и сл-но не сильно состоятельна

4. $\mathbb{E}(X_{(1)} + X_{(n)}) = \frac{\theta}{n+1} + \frac{\theta n}{n+1} = \theta \Rightarrow$ оц-ка не смещена. Т. к. $F_{X_{(1)}} \to F(x) = \begin{cases} 1, x \geq 0 \\ 0, x < 0 \end{cases}$,
   то $X_{(1)} \xrightarrow{P} 0 \Rightarrow$ по теореме о наследовании сходимости оценка является состоятельной.

5. Оценка явлется несмещенной и состоятельной

8. Пусть $\hat{\theta}_n(X)$ — асимптотически нормальная оценка параметра θ с асимптотической дисперсией $\sigma^2(\theta)$. Докажите, что тогда $\hat{\theta}_n(X)$ является состоятельной оценкой θ.

Решение. Пусть $\xi_n = \frac{1}{\sqrt{n}}$. $\xi_n \xrightarrow{P} 0$ По теореме о наследовании сходимости $\xi_n\sqrt{n}(\hat{\theta}_n(X) - \theta) \xrightarrow{P} 0 \Rightarrow \hat{\theta}_n(X) \xrightarrow{P} \theta$

9. Пусть $X_1, \ldots, X_n$ - выборка из распределения с параметром σ^2. Пусть, кроме того $D_{\sigma^2}X_1 = \sigma^2$ Докажите, что статистика $s = 1/n\sum_{i=1}^n(X_i - \overline{X})^2$ равна $\overline{X^2} - \left(\overline{X}\right)^2$ и является состоятельной оценкой σ^2. Является ли она несмещенной оценкой того же параметра?

Решение. $1/n\sum_{i=1}^n(X_i-\overline{X})^2 = 1/n\sum_{i=1}^n(X_i^2-2X_i\overline{X}+\left(\overline{X}\right)^2) = 1/n\sum_{i=1}^n X_i^2-2\overline{X}1/n\sum_{i=1}^n X_i-\left(\overline{X}\right)^2 = \overline{X^2}-2\left(\overline{X}\right)^2+\left(\overline{X}\right)^2 = \overline{X^2}-\left(\overline{X}\right)^2$. Подставляя в равентсво вместо X_i $X_i-\mathbb{E}X_i$ мы получим, что данная оценка равна $\overline{(X-\mathbb{E}X_1)^2}-(\overline{X}-\mathbb{E}X_1)^2 \xrightarrow{\text{п. н.}} \mathbb{D}X_1$ по УЗБЧ. Но $\mathbb{E}s = \mathbb{D}X_1-\mathbb{D}\overline{X} = \mathbb{D}X_1-\frac{1}{n}\mathbb{D}X_1 \neq \mathbb{D}X_1 \Rightarrow$ оценка смещена

10. Пусть $X_1,\ldots,X_n$ — выборка из экспоненциального распределения с параметром θ. Покажите, что $\forall k\in\mathbb{N}$ статистика $\sqrt[k]{k!/\overline{X^k}}$ является асимптотически нормальной оценкой параметра θ. Найдите ее асимптотическую дисперсию.

Решение.

$$\psi_{X_1}(t) = \mathbb{E}e^{itX_1} = \int_0^{+\infty}\theta e^{-\theta x}e^{itx}dx = \int_0^{+\infty}\theta e^{x(it-\theta)}dx = -\frac{\theta}{it-\theta} = \left(1-\frac{it}{\theta}\right)^{-1}$$

$$\frac{d^k}{dt^k}\psi_{X_1}(t) = \frac{i^k}{\theta^k}k!\left(1-\frac{it}{\theta}\right)^{-k-1} \Rightarrow \mathbb{E}X_1^k = \frac{k!}{\theta^k}$$

. Пользуясь теоремой 1.4 из С2 для $h(x) = \sqrt[k]{k!/x}, \xi_n = \sqrt{n}\left(\overline{X^k}-\frac{k!}{\theta^k}\right), b_n = 1/\sqrt{n}$ и $a = \frac{k!}{\theta^k}$.$h'(x) = (\sqrt[k]{k!}x^{-\frac{1}{k}})' = -\frac{1}{k}\sqrt[k]{\frac{k!}{x^{k+1}}} \Rightarrow h'(a) = -\frac{\theta^{k+1}}{k!k} \Rightarrow \sqrt{n}\left(\sqrt[k]{k!/\overline{X^k}}-\theta\right) \xrightarrow{d} \mathcal{N}\left(0,\sigma^2(\theta)\right)$, где $\sigma^2(\theta) = \left(\frac{\theta^k}{kk!}\right)^2$

11. Пусть $X_1,\ldots,X_n$ - выборка из распределения с плотностью

$$p_{\alpha,\beta}(x) = \frac{1}{\alpha}e^{(\beta-x)/\alpha}I_{[\beta,+\infty)}(x)$$

где $\theta = (\alpha,\beta)$ — двумерный параметр. Найдите для θ оценку максимального правдоподобия. Докажите, что полученная для α оценка $\hat{\alpha}_n$ является асимптотически нормальной, и найдите ее асимптотическую дисперсию.

Решение. Пусть $\theta = (\alpha,\beta)$

$$\mathcal{L}(x,\theta) = \frac{1}{\alpha^n}e^{\sum_{i=1}^n\frac{\beta-x_i}{\alpha}}I_{[\beta,+\infty]}(x_1,\ldots,x_n) = \frac{1}{\alpha^n}e^{\sum_{i=1}^n\frac{\beta-x_i}{\alpha}}I_{[\beta,+\infty]}(\min(x_1,\ldots,x_n))$$

Для того, чтобы произведение было не 0, должно выплняться $\beta\le\min(x_1,\ldots,x_n)$, в то же время $\mathcal{L}(x,\theta)\underset{\beta}{\to}\max_\beta \Leftrightarrow \sum_{i=1}^n\beta-x_i\underset{\beta}{\to}\max \Rightarrow \hat{\beta} = X_{(1)}$. $l(x,\theta) = \sum_{i=1}^n\frac{\beta-x_i}{\alpha}-n\ln\alpha \Rightarrow \hat{\alpha_n} = \sum_{i=1}^n\frac{X_i-\beta}{n} = \overline{X}-X_{(1)}$ в силу того, что функция $f(x) = \frac{c}{x}-\ln x, c\le 0$ имеет глобальный максимум в т. $x = -c$

12. Найдите оценку максимального правдоподобия для параметра сдвига в распределении Коши, т.е. плотность равна

$$p_\theta(x) = \frac{1}{\pi(1+(x-\theta)^2)}$$

если выборка состоит из а) одного наблюдения, б) двух на- блюдений (т.е. $n = 1, 2$).

Решение.

a $\mathcal{L}(x, \theta) = \frac{1}{1+(x-\theta)^2} \Rightarrow \hat{\theta} = X_1$

b $l(x, \theta) = -\ln(1 + (x_1 - \theta)^2) - \ln(1 + (x_2 - \theta)^2) \Rightarrow \frac{dl}{dx} = \frac{(x_1+x_2-2\theta)(\theta^2-\theta x_1-\theta x_2+x_1x_2+1)}{(1+(x_1-\theta)^2)(1+(x_2-\theta)^2)}$. Получаем 2 случая:

(a) $|x_1 - x_2| \leq 2$
Тогда уравенение правдоподобия имеет единственный корень $\frac{x_1+x_2}{2}$. Легко заметить, что в этой точке достигается максимум всей функции

(b) $|x_1 - x_2| > 2$. Тогда уравнение имеет 3 корня и максимум достигается в одной из точек $\frac{x_1+x_2}{2} + \sqrt{\left(\frac{x_1-x_2}{2}\right)^2 - 1}, \frac{x_1+x_2}{2} - \sqrt{\left(\frac{x_1-x_2}{2}\right)^2 - 1}$. Легко убедиться, что значение функции правдобободобия совпадают на них

Тогда оценка максимального правдобододобия $\hat{\theta} = \begin{cases} \frac{X_1+X_2}{2}, |X_1 - X_2| \leq 2 \\ \frac{X_1+X_2}{2} + \sqrt{\left(\frac{X_1-X_2}{2}\right)^2 - 1}, |X_1 - X_2| > 2 \end{cases}$

13. Пусть $X_1 \sim R(0, \theta)$. Найдите несмещённую оценку параметра $1/\theta$.

Решение.

14. Найдите несмещенную оценку λ^3 по выборке $X_1, \ldots, X_n$ из распределения $Pois(\lambda)$.

Решение. $\varphi_{X_1}(t) = \mathbb{E}e^{tX_1} = e^{\lambda(e^t-1)} \Rightarrow \frac{d}{dt}\varphi_{X_1}(t) = \lambda e^{t+\lambda(e^t-1)}, \frac{d^2}{dt^2}\varphi_{X_1}(t) = \lambda e^{t+\lambda(e^t-1)} + \lambda^2 e^{2t+\lambda(e^t-1)}, \frac{d^3}{dt^3}\varphi_{X_1}(t) = \lambda e^{t+\lambda(e^t-1)} + \lambda^2 e^{2t+\lambda(e^t-1)} + \lambda^2(2 + \lambda e^t)e^{2t+\lambda(e^t-1)} \Rightarrow \mathbb{E}X_1 = \lambda, \mathbb{E}X_1^2 = \lambda + \lambda^2, \mathbb{E}X_1^3 = \lambda^3 + 3\lambda^2 + \lambda \Rightarrow \hat{\lambda} = X_1^3 - 3X_1^2 + 2X_1$

15. Пусть $X_1, \ldots, X_n$ — выборка из равномерного распределения на отрезке $[0, \theta]$. Сравните следующие оценки параметра θ в равномерном подходе с квадратичной функцией потерь: $\theta : 2\overline{X}, (n+1)X_{(1)}, \frac{n+1}{n}X_{(n)}$.

Решение. Поскольку все оценки несмещены, фактически нужно сравнить дисперсии этих случайных величин.

1. $\mathbb{D}(2\overline{X}) = \frac{4}{n}\mathbb{D}X_1 = \frac{\theta^2}{3}$.

2. $\mathbb{D}(n+1)X_{(1)} = (n+1)^2\mathbb{D}X_{(1)}.\mathbb{E}X_{(1)}^2 = \int_0^\theta x^2 n \left(1 - \frac{x}{\theta}\right)^{n-1} \frac{1}{\theta}dx = n\theta^2 \int_0^1 t^2(1-t)^{n-1}dt = \theta^2 nB(3, n) = \theta^2 n\frac{2!(n-1)!}{(n+2)!} = \frac{2\theta^2}{(n+1)(n+2)} \Rightarrow \mathbb{D}X_1 = \frac{2\theta^2}{(n+1)(n+2)} - \frac{\theta^2}{(n+1)^2} = \frac{n\theta^2}{(n+1)^2(n+2)} \Rightarrow \mathbb{D}(n+1)X_{(1)} = \theta^2\left(1 - \frac{2}{n+2}\right)$

3. $\mathbb{E}X_{(n)}^2 = \int_0^\theta nx^2\frac{x^{n-1}}{\theta^n}dx = \theta^2\frac{n}{n+2} \Rightarrow \mathbb{D}X_{(n)} = \theta^2 n\left(\frac{1}{(n+2)} - \frac{n}{(n+1)^2}\right) = \theta^2\frac{n}{(n+1)^2(n+2)} \Rightarrow \mathbb{D}\frac{n+1}{n}X_{(n)} = \frac{\theta^2}{(n+1)(n+2)}$

Таким образом, $3_{\text{оц}}$ лучше $2_{\text{оц}}$ лучше $1_{\text{оц}}$

16. Пусть $\theta_1^*(X)$ и $\theta_2^*(X)$ — две наилучшие в среднеквадратичном подходе оценки параметра θ в классе всех оценок с од- ним и тем же математическим ожиданием $\tau(\theta)$. Докажите, что тогда для любого θ они совпадают почти наверное.

Решение.

17. Пусть $X_1, \ldots, X_n$ - выборка из нормального распределения с параметрами (a, σ^2). Найдите эффективную оценку а) параметра а, если σ известно; б) параметра σ^2 , если а известно. Вычислите информацию Фишера одного наблюдения в обоих случаях

Решение.

18. Пусть $X_1, \ldots, X_n$ — выборка из логистического распределения со сдвигом θ, имеющего плотность

$$p_\theta(x) = \frac{\exp\{\theta - x\}}{(1 + \exp\{\theta - x\})^2}$$

Найдите информацию Фишера $i(\theta)$ одного наблюдения в этой модели.

Решение.

19. С помощью метода моментов построить оценку параметра θ для следующих распределений: а)$Bern(\theta)$, б)$Pois(\theta)$, в)$\mathcal{N}(\theta, 1)$, г)$\exp(\theta)$. Является ли данная оценка:

1. несмещенной?
2. состоятельной?
3. сильно состоятельной?
4. асимптотически нормальной?

Решение. В первых 3 случаях оценка $\hat{\theta} = \overline{X}$ является несмещенной, состоятельной и сильно состоятельной по УЗБЧ. По ЦПТ также она явлется асимптотически нормальной с асимптотической дисперсией равной дисперсии этой случайной величины, то есть

a $\mathbb{D}X_1 = \theta(1 - \theta)$

b $\mathbb{D}X_1 = \theta$

c $\mathbb{D}X_1 = 1$

d $\mathbb{E}X_1 = 1/\theta \Rightarrow \hat{\theta} = \frac{1}{\overline{X}}$. По задаче 10 известно, что оценка асимптотически нормальная с ас дисперсией θ^2

20. Решить предыдущую задачу использую вместо метода моментов метод максимального правдоподобия.

Решение.

21. Рассмотрим распределения Коши с плотностью $p_\theta(x) = \frac{1}{\pi(1+(x-\theta)^2)}$. С помощью выборочной медианы построить асимптотически нормальную оценку для θ^2 и найти ее асимптотическую дисперсию.

Решение.

22. Пусть $X_1, \ldots, X_n$ — выборка из распределения: а)$Bern(\theta)$, б)$Pois(\theta)$, в)$\mathcal{N}(\theta, 1)$, г)$\exp(\theta)$. Для каких функций существует эффективная оценка? Найти соответствующую эффективную оценку и количество информации (фишеровской), содежащейся в одном сообщении.

Решение.

3. Достаточные статистики. Полные статистики. Оптимальные оценки.

23. Приведите пример такого параметрического семейства распределений P и нетривиальной неполной достаточной статистики $S(X_1, \ldots, X_n)$, где $X_1, \ldots, X_n$ — выборка из неизвестного распределения $P \in \mathcal{P}$, что размерность статистики S равна 1.

Решение.

24. Пусть $X_1, \ldots, X_n$ - выборка из нормального распределения с параметрами (a, σ^2), $a \in \mathbb{R}$, $\sigma > 0$. Найдите оптимальную оценку параметра $\theta = (a, \sigma^2)$.

Решение.

25. Пусть $X_1, \ldots, X_n$ — выборка из нормального распределения с параметрами $(0, \theta^2)$. Найдите оптимальную оценку для θ.

Решение.

26. Пусть $X_1, \ldots, X_n$ — выборка из пуассоновского распределения с параметром $\theta > 0$. Найдите $\mathbb{E}\left(X_1^2 \,\middle|\, \sum\limits_{i=1}^{n} X_i\right)$.

Решение.

27. С помощью критерия факторизации найти достаточную статистику для следующего семейства распределений: а)$Bern(\theta)$, б)$Pois(\theta)$, в)$\mathcal{N}(\theta, 1)$, г)$\exp(\theta)$. Проверить, является ли полученная статистика полной.

Решение.

28. Построить оптимальную оценку функции $\tau(\theta) = 5\theta^2 + 3\theta + 7$ для $Bern(\theta)$.

Решение.

29. Построить оптимальную оценку функции $\tau(\theta) = \sqrt{\theta}$ для $\exp(\theta)$