

¿CÓMO ASIGNAR LA DISTRIBUCIÓN PREVIA?: MÉTODO DE MÁXIMA ENTROPÍA

$$L(P, P'; \mathcal{H}) \equiv \int_{\mathcal{H}} P(\mathcal{H} | \mathcal{C}) \times \log 1/P(\mathcal{H} | \mathcal{C}) ; \sum_{i=0} \lambda_i g_i(P, P'; \mathcal{H})$$

Información esperada
ó Entropía, $H(P)$

Distribución de
Probabilidad *a priori*

Información adquirida
tras la observación

Restricciones impuestas por la
información contrastable

Las restricciones fijan propiedades macro

La información verificable define el conjunto de restricciones

$$\max H : \frac{\partial L}{\partial P} - \frac{d}{d\mathcal{H}} \frac{\partial L}{\partial P'} + \sum_i \lambda_i \frac{\partial g_i}{\partial P} = 0$$

Ecuación de Euler-Lagrange

