

# Математическая Статистика

2 мая 2014 г.



# Глава 1

## ОСНОВЫ

### 1.1 Методы оценок характеристик распределения наблюдаемых случайных величин

$x_1, \dots, x_n$  — независимые одинаково распределённые случайные величины с неизвестной функцией распределения  $F$ . Логично, что вероятность выпадения каждого  $x_k$  (вероятность того, что наугад взятый из выборки  $x$  будет равен  $x_k$ ) одинакова

$$P(x = x_k) = \frac{1}{n}$$

Цель — найти  $F$  или сказать что-то о её свойствах.

#### 1.1.1 Эмпирическая функция распределения

**Определение 1.1.1** (Эмпирическая функция распределения). Эмпирической (выборочной) функцией распределения, построенной по выборке  $x_1, \dots, x_n$  называется функция

$$F_n(x) = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \leq x)$$

**Теорема 1.1.1.** Неизвестная функция распределения  $F(x)$  может быть сколь угодно точно восстановлена по выборке достаточно большого объёма [1, стр. 25].

$$\mathbb{P}\left(F_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} F(x)\right) = 1$$

*Идея доказательства.* Вспомним, чему равна эмпирическая функция распределения

$$F_n(x) = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \leq x)$$

Заметим, что индикаторы  $\mathbb{1}(x_k \leq x)$  являются независимыми одинаково распределёнными случайными величинами, а функцию распределения  $F(x)$  можно записать следующим образом

$$F(x) = \mathbb{P}\{x_1 \leq x\} = M\mathbb{1}(x_1 \leq x)$$

Так как эмпирическая функция распределения является средним арифметическим индикаторов, то по усиленному закону больших чисел она сходится к неизвестной функции распределения почти наверное при устремлении длины выборки к бесконечности

$$F_n(x) = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \leq x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{a.s.} M\mathbb{1}(x_1) = F(x)$$

Теорема доказана

$$F_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{a.s.} F(x)$$

□

### 1.1.2 Гистограмма

Как можно попытаться отследить плотность распределения? Постараемся найти функцию распределения, а потом и плотность.

Допустим,  $F$  имеет хорошую (непрерывную) плотность. Как тогда из  $F$  получить  $p$ ?

Мы знаем, что  $F' = p$ , но это никому не нужно, так как  $F'_n$  — производная ступенчатой функции, которая почти везде будет равна нулю.

Но также мы помним, что

$$F(b) - F(a) = \int_a^b p(x) dx$$

Положим  $a = x$  и введём  $\Delta_x = b - x$

$$F(x + \Delta_x) - F(x) = \int_x^{x+\Delta_x} p(y) dy$$

Делим обе части на  $\Delta_x$ .

$$\frac{1}{\Delta_x} \cdot \int_x^{x+\Delta_x} p(y) dy = \frac{F(x + \Delta_x) - F(x)}{\Delta_x}$$

Несложно заметить, что при достаточно малых значениях  $\Delta_x$  получаем плотность распределения  $p(x)$

$$\frac{\Delta F(x)}{\Delta_x} \xrightarrow{\Delta_x \rightarrow 0} \frac{dF(x)}{dx} = p(x)$$

Значит, можем заменить  $p(x)$  не производной, а такой разностью.

$$p(x) \approx \frac{F(x + \Delta) - F(x)}{\Delta}$$

Возьмём  $m$  полуинтервалов на числовой прямой  $I_j = (a_{j-1}, a_j], i = \overline{1, m}$  таких, что все значения выборки попадают в один из них. Для этого определим пару свойств точек, ограничивающих эти интервалы:

### 1.1. Методы оценок характеристик распределения наблюдаемых случайных величин

1. Каждая следующая точка строго правее (больше) предыдущей. (так гистограмма как зачем нам одинаковые точки?)

$$a_0 < a_1 < \dots < a_m$$

2. Каждое значение выборки должно попадать ровно в один полуинтервал. Очевидно, что данные полуинтервалы  $I_j$  не пересекаются между собой. Значит, осталось потребовать, чтобы крайнее левое значение было меньше минимального значения из выборки, а крайнее правое — не больше максимального

$$a_0 < \min(X) \leq \max(X) \leq a_m$$

Введём функцию  $q(y)$

$$q(y) = \sum_{j=1}^m \frac{F(a_j) - F(a_{j-1})}{a_j - a_{j-1}} \cdot \mathbb{1}(y \in I_j)$$

Определим последовательность функций  $q_n(y)$ , заменив  $F(x)$  на  $F_n(x)$  в предыдущем определении

$$q_n(y) = \sum_{j=1}^m \frac{F_n(a_j) - F_n(a_{j-1})}{a_j - a_{j-1}} \cdot \mathbb{1}(y \in I_j) \quad (1.1)$$

Отметим, что  $q_n$  сходится к  $q$  почти наверное (согласно закону больших чисел), а  $q$  в свою очередь сходится к  $p$  (согласно центральной предельной теореме)

$$q_n(y) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{a.s.} q(y) \xrightarrow[m \rightarrow \infty]{} p(y)$$

Функция  $q_n$  называется **гистограммой**.

Избавимся от  $a_j$  в формуле, а для этого вспомним, чему равно  $F_n(x)$

$$F_n(x) = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \leq x)$$

Теперь посмотрим, чему равна разность  $F_n(a_j) - F_n(a_{j-1})$ , которая, как мы видим, является вероятностью того, что  $x$  попало в отрезок  $I_j$

$$\begin{aligned} F_n(a_j) - F_n(a_{j-1}) &= \\ &= \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \leq a_j) - \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \leq a_{j-1}) \end{aligned}$$

Сгруппируем слагаемые и получим чуть более компактную запись разности

$$\begin{aligned} F_n(a_j) - F_n(a_{j-1}) &= \\ &= \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n [\mathbb{1}(x_k \leq a_j) - \mathbb{1}(x_k \leq a_{j-1})] \end{aligned} \quad (1.2)$$

Рассмотрим возможные значения индикаторов

Если оба индикатора равны единице, это значит, что  $x_k$  не больше  $a_j$  и не больше  $a_{j-1}$ . Поскольку  $a_{j-1} \leq a_j$ , то можно обойтись тем, что  $x \leq a_{j-1}$

$$\begin{aligned} \begin{cases} \mathbb{1}(x_k \leq a_j) = 1 \\ \mathbb{1}(x_k \leq a_{j-1}) = 1 \\ a_{j-1} \leq a_j \end{cases} &\Rightarrow \begin{cases} x_k \leq a_j \\ x_k \leq a_{j-1} \\ a_{j-1} \leq a_j \end{cases} \\ &\Rightarrow x_k \leq a_{j-1} \leq a_j \Rightarrow x_k \leq a_{j-1} \end{aligned}$$

Такая ситуация, что  $x$  больше, чем  $a_j$ , но не больше, чем  $a_{j-1}$ , невозможна, так как  $a_{j-1}$  не больше, чем  $a_j$ , а признать возможной такое положение дел ( $a_j < x_k \leq a_{j-1}$ ) означало бы то, что  $a_j < a_{j-1}$

$$\begin{aligned} \begin{cases} \mathbb{1}(x_k \leq a_j) = 0 \\ \mathbb{1}(x_k \leq a_{j-1}) = 1 \\ a_{j-1} \leq a_j \end{cases} &\Rightarrow \begin{cases} x_k > a_j \\ x_k \leq a_{j-1} \\ a_{j-1} \leq a_j \end{cases} \\ &\Rightarrow \begin{cases} a_j < x_k \leq a_{j-1} \\ a_{j-1} \leq a_j \end{cases} \end{aligned}$$

Если оба индикатора равны нулю, то это значит, что  $x$  строго больше как  $a_j$ , так и  $a_{j-1}$ . Опять же, поскольку  $a_{j-1} \leq a_j$ , то достаточно сказать, что  $x > a_j$ .

$$\begin{aligned} \begin{cases} \mathbb{1}(x_k \leq a_j) = 0 \\ \mathbb{1}(x_k \leq a_{j-1}) = 0 \\ a_{j-1} \leq a_j \end{cases} &\Rightarrow \begin{cases} x_k > a_j \\ x_k > a_{j-1} \\ a_j \geq a_{j-1} \end{cases} \\ &\Rightarrow x_k > a_j \geq a_{j-1} \Rightarrow x_k > a_j \end{aligned}$$

Если же  $x$  больше, чем  $a_{j-1}$ , но не больше, чем  $a_j$ , то  $x$  попадает в полуинтервал  $(a_{j-1}, a_j]$

$$\begin{aligned} \begin{cases} \mathbb{1}(x_k \leq a_j) = 1 \\ \mathbb{1}(x_k \leq a_{j-1}) = 0 \\ a_{j-1} \leq a_j \end{cases} &\Rightarrow \begin{cases} x_k \leq a_j \\ x_k > a_{j-1} \\ a_j \geq a_{j-1} \end{cases} \\ &\Rightarrow a_{j-1} < x_k \leq a_j \end{aligned}$$

Вспомним формулу (1.2)

$$\begin{aligned} F_n(a_j) - F_n(a_{j-1}) &= \\ &= \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n [\mathbb{1}(x_k \leq a_j) - \mathbb{1}(x_k \leq a_{j-1})] \end{aligned}$$

Очевидно, что нас интересуют те пары, разность которых не равна нулю. Это значит, что те случаи, когда  $x > a_j$  или  $x \leq a_{j-1}$ , нас не интересуют. Поскольку такой случай, что  $a_j < x \leq a_{j-1}$  невозможен, то его тоже отбросим. Значит, остался только тот вариант, когда  $x$  попадает в полуинтервал  $(a_{j-1}, a_j]$

$$\frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n [\mathbb{1}(x_k \leq a_j) - \mathbb{1}(x_k \leq a_{j-1})] = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \in (a_{j-1}, a_j])$$

### 1.1. Методы оценок характеристик распределения наблюдаемых случайных величин 7

Видим знакомые полуинтервалы  $(a_{j-1}, a_j] = I_j$ . Воспользуемся этим

$$\frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \in (a_{j-1}, a_j]) = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \in I_j)$$

Получаем компактную запись для разности функций распределения

$$F_n(a_j) - F_n(a_{j-1}) = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \in I_j) \quad (1.3)$$

Вернёмся к уравнению (1.1)

$$q_n(y) = \sum_{j=1}^m \frac{F_n(a_j) - F_n(a_{j-1})}{a_j - a_{j-1}} \cdot \mathbb{1}(y \in I_j)$$

Воспользовавшись тем, что  $(a_j - a_{j-1})$  — длина полуинтервала  $I_j$ , а разность  $F_n(a_j) - F_n(a_{j-1})$  была только что переписана через индикаторы, получаем такую формулу

$$q_n(y) = \sum_{j=1}^m \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \in I_j) \cdot \frac{1}{|I_j|} \cdot \mathbb{1}(y \in I_j)$$

Упростим, введя функцию  $\nu_j(X)$  [1, стр. 68], которая считает количество элементов выборки  $X = x_1, \dots, x_n$ , попавших в интервал  $I_j$ . Это будет сумма индикаторов того, что элемент  $x_k$  попал в  $I_j$

$$\nu_j(X) = \sum_{x \in X} \mathbb{1}(x \in I_j) = \sum_{k=1}^n \mathbb{1}(x_k \in I_j)$$

Поскольку  $\mathbb{1}(y \in I_j)$  зависит от  $j$  и не зависит от  $k$ , то его можно перенести во внешнюю сумму. Получаем следующую формулу

$$q_n(y) = \sum_{j=1}^m \frac{\mathbb{1}(y \in I_j)}{n \cdot |I_j|} \cdot \nu_j(X)$$

У этой суммы только один ненулевой элемент, так как  $y$  может попасть только в один полуинтервал. Тогда обозначим номер отрезка, в который попал  $y$ , через  $k$  ( $y \in I_k$ ), а функцию  $q_n(y)$  запишем как  $q_n^k$

$$q_n^k = \frac{\nu_k(X)}{n \cdot |I_k|} \quad (1.4)$$

Что мы тут видим? Теперь  $k$  — номер “столбика” гистограммы (номер интересующего нас полуинтервала — того, в который попал  $y$ ).

“Высота” столбика (значение функции на определённом полуинтервале) пропорциональна количеству элементов, попавших в этот отрезок (что логично). Кроме того, происходит деление на общее количество элементов. Деление нужно, чтобы  $q(y)$  сходилось к  $p(y)$ .

Делителю же  $|I_k|$  отведена особая роль — он предотвращает искажение гистограммы при различных длинах отрезков. То есть, чем длиннее отрезок, тем ниже столбик, так как элементы более “размазаны” по отрезку, что тоже логично.

неизвестный параметр  
статистика  
оценка

Представим, что значение функции — это высоту прямоугольника, а длина отрезка — его ширина (графически это изображается именно так). Тогда отношение количества элементов, попавших в полуинтервал, к количеству всех элементов выборки (вероятность того, что случайно взятый элемент из выборки попадёт в  $k$ -ый отрезок [1, стр. 24]), является площадью прямоугольника

$$S_k = \frac{\nu_k(X)}{n} = \mathbb{P}_n(x \in I_k)$$

Введём замену в формуле (1.4) и умножим обе части на длину отрезка

$$\mathbb{P}_n(x \in I_k) = q_n^k \cdot |I_k|$$

Если устремить количество полуинтервалов к бесконечности ( $m \rightarrow \infty$ ), то каждый полуинтервал будет сжиматься в точку. При этом вероятность попадания  $x$  в отрезок будет стремиться к вероятности попадания  $x$  в точку  $y$ . Введём обозначения  $|I_j| = \delta$ ,  $I_j = \Delta_y$

$$\mathbb{P}_n(x = y) \approx \mathbb{P}_n(x \in \Delta_y) = q_n(y) \cdot \delta, \quad m \rightarrow \infty$$

Очень напоминает ситуацию с плотностью распределения непрерывной случайной величины  $\xi$

$$\mathbb{P}(\xi = x) \approx p(x) \cdot \delta, \quad \delta \rightarrow 0$$

Нужно отметить, что количество элементов выборки должно стремиться к бесконечности ( $n \rightarrow \infty$ ), так как плотность может быть лишь у непрерывных случайных величин. Чем больше будет элементов, тем плотнее они будут стоять на числовой прямой.

### 1.1.3 Оценка неизвестных параметров

Снова у нас есть  $x_1, \dots, x_n$  — выборка из распределения  $F_\theta$ , где  $\theta$  — неизвестный параметр из множества  $\Theta$

**Пример 1.1.1.** Имеем нормальное распределение с известным СКО  $\sigma = 1$  и неизвестным математическим ожиданием  $a$  —  $N(a, 1)$ . Тогда  $\theta$  — математическое ожидание  $a$

**Пример 1.1.2.** Есть нормальное распределение, в котором неизвестны оба параметра. Тогда  $\theta$  будет парой  $(a, \sigma)$

Главный вопрос — определение основных параметров распределения выборки.

**Определение 1.1.2** (Статистика). Статистикой называют функцию  $S$  от выборки  $X = (x_1, x_2, \dots, x_n)$

$$S(X) = S(x_1, x_2, \dots, x_n)$$

**Определение 1.1.3** (Оценка). Статистику, значение которой заменяет неизвестный параметр, называют оценкой



### 1.1. Методы оценок характеристик распределения наблюдаемых случайных величин<sup>9</sup>

**Пример 1.1.3.** Предположим, что выборка сделана из распределения Бернулли, то есть  $\{x_i\}$  — набор одинаково распределённых случайных величин, причём оценка! состоятельная  
оценка! сильно  
состоятельная

$$x_i = \begin{cases} 1, & p \\ 0, & 1 - p \end{cases}$$

Тогда неизвестный параметр — величина  $p$  (вероятность удачного эксперимента)

$$\theta = p \in [0; 1] = \Theta$$

Введём разные оценки  $\hat{p}$

$$\hat{p}_1 = \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n x_k$$

$$\hat{p}_2 = x_1$$

$$\hat{p}_3 = \frac{2}{n} \sum_{k=1}^{\lfloor \frac{n}{2} \rfloor} x_k$$

Замечание: Поскольку  $\hat{p}$  — случайная величина, то может оказаться, что она не равна настоящему параметру  $p$

$$\mathbb{P} \{ \hat{p} = p \} = 0$$

1. Возникает мысль о том, что разность  $\hat{p} - p$  должна быть “маленькой”. Например, чтобы  $M(\hat{p} - p)^2$  было самое маленькое из возможных.
2. Также логично желать того, чтобы оценка  $\hat{p}$  сходилась к истинному значению параметра  $p$  по вероятности ( $\hat{p} \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{\mathbb{P}} p$ ) или почти всюду ( $\hat{p} \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{a.s.} p$ )
3. При многократном повторении эксперимента даже самая (на первый взгляд) плохая оценка может оказаться полезной

$$M\hat{p}_1 = p$$

$$M\hat{p}_2 = p$$

$$M\hat{p}_3 = p$$

Например, если целый год каждый день дают набор чисел, а статистик считает значение параметра  $p$  с помощью оценки  $\hat{p}_2$ , то в среднем за год у него получится величина, близкая к истинному  $p$ .

**Определение 1.1.4** (Состоятельная оценка). Оценка  $\hat{\theta}$  называется состоятельной, если стремится к истинному значению  $\theta$  по вероятности

$$\hat{\theta} \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{\mathbb{P}} \theta$$

оценка!несмещённая

**Определение 1.1.5** (Сильно состоятельная оценка). Оценка  $\hat{\theta}$  называется *сильно состоятельной*, если стремится к истинному значению  $\theta$  почти наверное

$$\hat{\theta} \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{a.s.} \theta$$

**Пример 1.1.4.** Оценка  $\hat{p}_1$  из прошлого примера является сильно состоятельной.

**Определение 1.1.6** (Несмещённая оценка). Оценка  $\hat{\theta}$  несмещённая, если

$$\forall \theta \in \Theta : M_{\theta} \hat{\theta} = \theta$$

**Замечание 1.** Несмещённая оценка существует не всегда

**Определение 1.1.7.** Несмещённая оценка  $\hat{\theta} \in K$  называется *оптимальной* в классе квадратично интегрируемых оценок  $K$ , если для всякой другой несмещённой оценки  $\tilde{\theta} \in K$

$$D_{\theta} \hat{\theta} \leq D_{\theta} \tilde{\theta}, \quad \forall \theta \in \Theta$$

или же

$$M_{\theta} (\hat{\theta} - \theta)^2 \leq M_{\theta} (\tilde{\theta} - \theta)^2, \quad \forall \theta \in \Theta$$

**Замечание 2.** В учебнике Боровкова А. А. “Математическая статистика” оценка, удовлетворяющая этим условиям, носит название **эффективная оценка** [1, стр. 130], но у нас этот термин будет использоваться далее в другом смысле

**Пример 1.1.5.** Сравним  $\hat{p}_1$  и  $\hat{p}_3$

$$D_p \hat{p}_1 = \frac{1}{n^2} \cdot n \cdot p \cdot (1-p) = \frac{p \cdot (1-p)}{n}$$

$$D_p \hat{p}_3 = \frac{2 \cdot p \cdot (1-p)}{n}$$

#### 1.1.4 Выборочные оценки. Метод моментов

Как восстановить неизвестный параметр  $\theta \in \Theta$  из функции распределения  $F_{\theta}(x)$ ?

Вспомним распределения и их параметры

1. Нормальное распределение  $N(a, \sigma^2)$ . В нём параметр  $a$  является средним, а параметр  $\sigma^2$  — дисперсией
2. Пуассоновское распределение  $Poi(\lambda)$ . Тут параметр  $\lambda$  является и средним, и дисперсией
3. Экспоненциальное распределение  $Exp(\lambda)$ .  $\frac{1}{\lambda}$  — среднее,  $\frac{1}{\lambda^2}$  — дисперсия

И так далее...

Как правило, неизвестный параметр  $\theta$  можно искать следующим образом

$$\exists \varphi \in C(\mathbb{R}) : \int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dF_{\theta}(x) = g(\theta)$$

Значит, у нас есть уравнение для поиска оценки  $\hat{\theta}$  при непрерывной и монотонной  $g(\hat{\theta})$

$$g(\hat{\theta}) = \int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dF_n(x) \quad (1.5)$$

**Пример 1.1.6.** Если  $\theta$  — среднее, то  $\varphi(x) = x$

$$\int_{-\infty}^{+\infty} x dF_{\theta}(x) = \theta = g(\theta)$$

**Теорема 1.1.2.** Пусть функция  $\varphi(x)$  в (1.5) непрерывна, ограничена и строго монотонная. Тогда оценка  $\hat{\theta}$  существует и является сильно состоятельной.

*Доказательство.* Имеем формулу (1.5)

$$g(\hat{\theta}) = \int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dF_n(x)$$

Поскольку функция  $g(\hat{\theta})$  непрерывна и монотонна, то она имеет обратную функцию  $g^{-1} : g(\hat{\theta}) \rightarrow \hat{\theta}$ .

Применим обратную функцию к обеим частям уравнения

$$\hat{\theta} = g^{-1} \left( \int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dF_n(x) \right)$$

Поскольку выборочная функция распределения почти всюду равна неизвестной функции распределения при достаточно большом объёме выборки, то

$$\int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dF_n(x) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{a.s.} \int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dF_n(x)$$

Функция  $g^{-1}(x)$  непрерывна

$$\hat{\theta} = g^{-1} \left( \int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dF_n(x) \right) \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{a.s.} g^{-1} \left( \int_{\mathbb{R}} \varphi(x) dF_n(x) \right) = \theta$$

Теорема доказана

$$\hat{\theta} \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{a.s.} \theta$$

□

выборочное среднее  
выборочная дисперсия  
теорема Колмогорова

**Определение 1.1.8** (Выборочное среднее). *Выборочное среднее обозначается через  $\bar{x}$  и считается по следующей формуле*

$$\bar{x} = \int_{\mathbb{R}} x dF_n(x)$$

*Поскольку все элементы выборки равновероятны, получаем математическое ожидание дискретной равномерно распределённой случайной величины, принимающей  $n$  значений*

$$\bar{x} = \int_{\mathbb{R}} x dF_n(x) = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n x_k$$

**Определение 1.1.9** (Выборочная дисперсия). *Выборочная дисперсия  $\overline{\sigma^2}$  считается формуле*

$$\overline{\sigma^2} = \int_{\mathbb{R}} (x - \bar{x})^2 dF_n(x) = \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n (x_k - \bar{x})^2$$

## 1.2 Свойства оценок

### 1.2.1 Неравенство Рао-Крамера

**Теорема 1.2.1** (Колмогорова). *Оптимальная оценка единственная или её нет вообще*

*Доказательство.* Допустим, есть две разные оптимальные и несмещённые оценки  $\theta_1$  и  $\theta_2$ . Тогда по определению для любой несмещённой оценки  $\hat{\theta}$  будет

$$\begin{cases} D_{\theta}\theta_1 \leq D_{\theta}\hat{\theta} \\ D_{\theta}\theta_2 \leq D_{\theta}\hat{\theta} \end{cases}, \forall \theta \in \Theta$$

Поскольку неравенство выполняется для каждой несмещённой оценки  $\hat{\theta}$ , а оценки  $\theta_1$  и  $\theta_2$  являются несмещёнными, то можем их и поставить в неравенство в роли  $\hat{\theta}$

$$\begin{cases} D_{\theta}\theta_1 \leq D_{\theta}\theta_2 \\ D_{\theta}\theta_2 \leq D_{\theta}\theta_1 \end{cases}, \forall \theta \in \Theta$$

А это возможно только если дисперсии этих оценок равны. Обозначим эту дисперсию через  $\sigma^2(\theta)$

$$D_{\theta}\theta_1 = D_{\theta}\theta_2 = \sigma^2(\theta)$$

Возьмём несмещённую оценку  $\tilde{\theta}$ , равную среднеарифметическому оценок  $\theta_1$  и  $\theta_2$

$$\tilde{\theta} = \frac{1}{2} \cdot \theta_1 + \frac{1}{2} \cdot \theta_2$$

Тогда по определению  $\theta_1$  и  $\theta_2$  получаем, что дисперсия новой оценки не меньше, чем у оптимальных

$$D_{\theta}\tilde{\theta} \geq \sigma^2(\theta) \quad (1.6)$$

Попробуем честно вычислить дисперсию оценки  $\tilde{\theta}$

$$\begin{aligned} D_{\theta}\tilde{\theta} &= M_{\theta}(\tilde{\theta} - \theta) = M_{\theta} \left[ \frac{1}{2} \cdot (\theta_1 - \theta) + \frac{1}{2} \cdot (\theta_2 - \theta) \right]^2 = \\ &= \frac{1}{4} \cdot D_{\theta}\theta_1 + \frac{1}{4} \cdot D_{\theta}\theta_1 + \frac{1}{2} \cdot M_{\theta}[(\theta_1 - \theta) \cdot (\theta_2 - \theta)] \end{aligned}$$

Воспользуемся неравенством Коши (частный случай неравенства Гёльдера)

$$\begin{aligned} M_{\theta}[(\theta_1 - \theta) \cdot (\theta_2 - \theta)] &\leq \sqrt{M_{\theta}(\theta_1 - \theta)^2 \cdot M_{\theta}(\theta_2 - \theta)^2} = \\ &= \sqrt{D_{\theta}\theta_1 \cdot D_{\theta}\theta_2} = \sqrt{\sigma_1^2 \cdot \sigma_2^2} \end{aligned} \quad (1.7)$$

И вернёмся к вычислению дисперсии оценки  $\tilde{\theta}$

$$\begin{aligned} \frac{1}{4} \cdot D_{\theta}\theta_1 + \frac{1}{4} \cdot D_{\theta}\theta_1 + \frac{1}{2} \cdot M_{\theta}[(\theta_1 - \theta) \cdot (\theta_2 - \theta)] &\leq \\ &\leq \frac{1}{2} \cdot \sigma^2(\theta) + \frac{1}{2} \cdot \sqrt{\sigma^2(\theta) \cdot \sigma^2(\theta)} = \sigma^2(\theta) \end{aligned}$$

То есть, дисперсия оценки  $\tilde{\theta}$  не больше дисперсии введённой оптимальной оценки

$$D_{\theta}\tilde{\theta} \leq \sigma^2(\theta) \quad (1.8)$$

Воспользовавшись неравенствами (1.6) и (1.8), получаем равенство

$$D_{\theta}\tilde{\theta} = \sigma^2(\theta)$$

Это значит, что в неравенстве (1.7) в данном случае тоже выходит равенство

$$M_{\theta}[(\theta_1 - \theta) \cdot (\theta_2 - \theta)] = \sqrt{M_{\theta}(\theta_1 - \theta)^2} \cdot \sqrt{M_{\theta}(\theta_2 - \theta)^2}$$

Для дальнейших размышлений вспомним аналогию с векторами, а именно смысл равенства в неравенстве Коши для скалярного произведения векторов

$$\vec{a} \cdot \vec{b} = |\vec{a}| \cdot |\vec{b}| \cdot \cos(\widehat{\vec{a}, \vec{b}}) = \sqrt{\vec{a}^2} \cdot \sqrt{\vec{b}^2} \cdot \cos(\widehat{\vec{a}, \vec{b}})$$

Скалярное произведение двух векторов равно произведению их модулей только тогда, когда они сонаправлены

$$(\widehat{\vec{a}, \vec{b}}) = 0 \Rightarrow \vec{a} \cdot \vec{b} = \sqrt{\vec{a}^2} \cdot \sqrt{\vec{b}^2}$$

функция правдоподобия

Положим математическое ожидание нормой, а  $\theta_1 - \theta$  и  $\theta_2 - \theta$  векторами пространства случайных событий. Получаем, что нормы и направления этих векторов совпадают

$$\begin{aligned} M_\theta [(\theta_1 - \theta) \cdot (\theta_2 - \theta)] &= \sqrt{M_\theta (\theta_1 - \theta)^2} \cdot \sqrt{M_\theta (\theta_2 - \theta)^2} \\ &\Rightarrow \widehat{(\theta_1 - \theta, \theta_2 - \theta)} \end{aligned}$$

Это значит, что они равны, что противоречит предположению о том, что они разные

$$\begin{aligned} \begin{cases} \widehat{(\theta_1 - \theta, \theta_2 - \theta)} = 0 \\ M_\theta (\theta_1 - \theta)^2 = M_\theta (\theta_2 - \theta)^2 \end{cases} &\Rightarrow \theta_1 - \theta = \theta_2 - \theta \\ &\Rightarrow \theta_1 = \theta_2 \end{aligned}$$

Теорема доказана □

Для дальнейших действий будем считать, что функция распределения  $F_\theta(x)$  имеет плотность  $p(x, \theta)$ , которая дважды дифференцируема по  $\theta$ . То есть её можно дифференцировать под знаком интеграла.

Также отметим, что выборка  $(x_1, \dots, x_n)$  имеет плотность распределения, так как является случайным вектором в  $\mathbb{R}^n$ , все компоненты которого — случайные величины.

**Определение 1.2.1** (Функция правдоподобия). *Плотность распределения вектора независимых случайных величин, равная произведению плотностей распределения его компонент, называется функцией правдоподобия*

$$L(\vec{x}, \theta) = \prod_{k=1}^n p(x_k, \theta)$$

Прологарифмировав функцию правдоподобия, получим симпатичную сумму

$$\ln L(\vec{x}, \theta) = \sum_{k=1}^n \ln p(x_k, \theta)$$

А симпатична она тем, что это сумма незасимых одинаково распределённых случайных величин. Воспользовавшись законом больших чисел, можем сказать, что она стремится к сумме  $n$  одинаковых математических ожиданий при достаточно большом размере выборки

$$\begin{aligned} \ln L(\vec{x}, \theta) &= n \cdot \frac{\ln p(x_1, \theta) + \dots + \ln p(x_n, \theta)}{n} \approx \\ &\approx n \cdot M_\theta \ln p(x_1, \theta) \end{aligned}$$

Проблема в том, что мы не знаем среднего. Для разрешения этого вопроса введём ещё одно определение

**Определение 1.2.2** (Вклад выборки). *Вклад выборки — частная производная по параметру  $\theta$  от логарифма функции правдоподобия*

$$\begin{aligned} U(\vec{x}, \theta) &= \frac{\partial}{\partial \theta} \ln L(\vec{x}, \theta) = \sum_{k=1}^n \frac{\partial}{\partial \theta} \cdot \ln p(x_k, \theta) \\ &= \frac{\frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{x}, \theta)}{L(\vec{x}, \theta)} \end{aligned}$$

**Замечание 3.** *Математическое ожидание вклада выборки равно нулю*

$$M_{\theta} U(\vec{x}, \theta) = 0$$

*Доказательство.* Посчитаем математическое ожидание вклада выборки

$$\begin{aligned} M_{\theta} U(\vec{x}, \theta) &= \int_{\mathbb{R}^n} U(\vec{u}, \theta) \cdot L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} = \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} \frac{\frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{x}, \theta)}{L(\vec{x}, \theta)} \cdot L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} = \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} \frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} \end{aligned}$$

Воспользовавшись предположением о том, что функция распределения дважды дифференцируема, вынесем взятие производной за знак интеграла

$$M_{\theta} U(\vec{x}, \theta) = \frac{\partial}{\partial \theta} \int_{\mathbb{R}^n} L(\vec{u}, \theta) d\vec{u}$$

Поскольку интегрируем плотность распределения случайного вектора по всему пространству, то он равен единице. Производная же от единицы равна нулю. Это значит, что математическое ожидание вклада выборки равно нулю

$$M_{\theta} U(\vec{x}, \theta) = \frac{\partial}{\partial \theta} \int_{\mathbb{R}^n} L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} = \frac{\partial}{\partial \theta} 1 = 0$$

□

**Замечание 4.** *Частная производная по оценке  $\theta$  от функции правдоподобия  $L(\vec{u}, \theta)$  равна нулю.*

*Доказательство.* Выше у нас было равенство

$$\frac{\partial}{\partial \theta} \int_{\mathbb{R}^n} L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} = 0$$

Так как производную можем заносить под знак интеграла (согласно нашему предположению), то получаем такое равенство

$$\int_{\mathbb{R}^n} \frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} = 0$$

количество информации  
Фишера  
неравенство Рао-Крамера

Поскольку интеграл не зависит от  $\theta$ , то такое возможно лишь в том случае, когда производная равна нулю

$$\frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{u}, \theta) = 0$$

□

**Определение 1.2.3** (Количество информации Фишера). Математическое ожидание квадрата вклада выборки называется количеством информации Фишера

$$I_n(\theta) = M_\theta U(\vec{x}, \theta)^2$$

**Замечание 5.**

$$M_\theta U(\vec{x}, \theta)^2 = -M_\theta \frac{\partial^2}{\partial \theta^2} \ln L(\vec{x}, \theta)$$

*Доказательство.* Будем доказывать справа налево

$$\begin{aligned} -M_\theta \frac{\partial^2}{\partial \theta^2} \ln L(\vec{x}, \theta) &= -M_\theta \frac{\partial}{\partial \theta} \frac{\frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{x}, \theta)}{L(\vec{x}, \theta)} = \\ &= -M_\theta \left( \frac{\frac{\partial^2}{\partial \theta^2} L(\vec{x}, \theta) \cdot L(\vec{x}, \theta) - \left[ \frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{x}, \theta) \right]^2}{L(\vec{x}, \theta)^2} \right) = \\ &= -M_\theta \frac{\frac{\partial^2}{\partial \theta^2} L(\vec{x}, \theta)}{L(\vec{x}, \theta)} + M_\theta \left[ \frac{\frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{x}, \theta)}{L(\vec{x}, \theta)} \right]^2 \end{aligned}$$

Помним, что производная от функции правдоподобия по  $\theta$  равна нулю. Значит вторая производная тоже равна нулю и остаётся лишь математическое ожидание квадрата, который равен квадрату производной логарифма функции правдоподобия, что в свою очередь и есть вклад выборки

$$\begin{aligned} \frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{u}, \theta) = 0 &\Rightarrow -M_\theta \frac{\frac{\partial^2}{\partial \theta^2} L(\vec{x}, \theta)}{L(\vec{x}, \theta)} = 0 \\ \Rightarrow -M_\theta \frac{\partial^2}{\partial \theta^2} \ln L(\vec{x}, \theta) &= M_\theta \left[ \frac{\frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{x}, \theta)}{L(\vec{x}, \theta)} \right]^2 = \\ &= M_\theta \left[ \frac{\partial}{\partial \theta} \ln L(\vec{x}, \theta) \right]^2 = M_\theta U(\vec{x}, \theta)^2 \end{aligned}$$

Утверждение доказано

$$M_\theta U(\vec{x}, \theta)^2 = -M_\theta \frac{\partial^2}{\partial \theta^2} \ln L(\vec{x}, \theta)$$

□

Количество информации позволяет оценить точность, с которой можем получить параметр  $\theta$

**Теорема 1.2.2** (Неравенство Рао-Крамера). Пусть  $\hat{\theta}$  — несмещённая оценка параметра  $\theta$ . Тогда имеет место неравенство

$$\forall \theta \in \Theta : D_\theta \hat{\theta} \geq \frac{1}{I_n(\theta)}$$



*Доказательство.* Выпишем, чему равно математическое ожидание оценки  $\theta$

$$\begin{cases} M_\theta \hat{\theta} &= \theta \\ M_\theta \hat{\theta} &= \int_{\mathbb{R}^n} \hat{\theta}(\vec{u}) \cdot L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} \end{cases}$$

$$\Rightarrow \theta = \int_{\mathbb{R}^n} \hat{\theta}(\vec{u}) \cdot L(\vec{u}, \theta) d\vec{u}$$

Продифференцируем с двух сторон полученное для  $\theta$  равенство по самому параметру  $\theta$

$$\frac{\partial}{\partial \theta} \theta = \frac{\partial}{\partial \theta} \int_{\mathbb{R}^n} \hat{\theta}(\vec{u}) \cdot L(\vec{u}, \theta) d\vec{u}$$

Левая часть равенства превращается в единицу, а справа заносим взятие производной под знак интеграла. Также помним, что оценка  $\theta(\vec{u})$  не зависит от параметра  $\theta$ . Это значит, что производную нужно брать только от функции правдоподобия

$$1 = \int_{\mathbb{R}^n} \hat{\theta}(\vec{u}) \cdot \frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{u}, \theta) d\vec{u}$$

Далее нам нужно получить вклад выборки. Для этого умножим и поделим подинтегральное выражение на функцию правдоподобия

$$\begin{aligned} & \int_{\mathbb{R}^n} \hat{\theta}(\vec{u}) \cdot \frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} = \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} \hat{\theta}(\vec{u}) \cdot \frac{\frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{u}, \theta)}{L(\vec{u}, \theta)} \cdot L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} \end{aligned}$$

Видим, что дробь под интегралом — производная логарифма функции правдоподобия, которая является вкладом выборки

$$\begin{aligned} & \int_{\mathbb{R}^n} \hat{\theta}(\vec{u}) \cdot \frac{\frac{\partial}{\partial \theta} L(\vec{u}, \theta)}{L(\vec{u}, \theta)} \cdot L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} = \\ &= \int_{\mathbb{R}^n} \hat{\theta}(\vec{u}) \cdot U(\vec{x}, \theta) \cdot L(\vec{u}, \theta) d\vec{u} \end{aligned}$$

У нас есть математическое ожидание произведения оценки и вклада выборки, которое равно единице

$$1 = M_\theta \left( \hat{\theta} \cdot U(\vec{x}, \theta) \right) \quad (1.9)$$

Помним, что математическое ожидание вклада выборки равно нулю. Значит, умножение его на константу ничего не меняет

$$\begin{aligned} M_\theta U(\vec{x}, \theta) &= 0 \\ \Rightarrow \theta \cdot M_\theta U(\vec{x}, \theta) &= M_\theta (\theta \cdot U(\vec{x}, \theta)) = 0 \end{aligned}$$

оценка!эффективная

Воспользовавшись полученным результатом, вернёмся к равенству (1.9). Отнимем от обеих частей ноль (то есть, полученное только что выражение)

$$1 = M_{\theta} \left( \hat{\theta} \cdot U(\vec{x}, \theta) \right) - M_{\theta} (\theta \cdot U(\vec{x}, \theta))$$

Получаем компактное равенство

$$1 = M_{\theta} \left[ (\hat{\theta} - \theta) \cdot U(\vec{x}, \theta) \right]$$

Воспользовавшись неравенством Коши, узнаём, произведение корней дисперсии и количества информации больше, чем единица

$$\begin{aligned} 1 &= M_{\theta} \left[ (\hat{\theta} - \theta) \cdot U(\vec{x}, \theta) \right] \leq \\ &\leq \sqrt{M_{\theta} (\hat{\theta} - \theta)} \cdot \sqrt{M_{\theta} U(\vec{x}, \theta)} = \\ &= \sqrt{D_{\theta} \hat{\theta}} \cdot \sqrt{I_n(\theta)} \end{aligned} \quad (1.10)$$

Возводим обе части равенства в квадрат и делим на количество информации

$$D_{\theta} \hat{\theta} \geq \frac{1}{I_n(\theta)}$$

Неравенство доказано  $\square$

**Замечание 6.** Иногда нужно оценивать не сам параметр, а функцию параметра

Если  $\alpha$  — несмещённая оценка для  $f(\theta)$ , то справедливо следующее неравенство

$$\forall \theta \in \Theta : D_{\theta} \alpha \geq \frac{|f'(\theta)|}{I_n(\theta)}$$

## 1.2.2 Метод максимального правдоподобия

У нас есть нижняя оценка точности, с которой можно отыскать желаемую оценку, а это значит, что точнее определить просто не получится и нужно стремиться к равенству в неравенстве Рао-Крамера.

**Определение 1.2.4** (Эффективная оценка). Оценка  $\hat{\theta}$ , для которой в неравенстве Рао-Крамера стоит равенство, называется эффективной

$$\forall \theta \in \Theta : D_{\theta} \hat{\theta} = \frac{1}{I_n(\theta)}$$

Попытаемся выяснить, какими свойствами должна обладать плотность, чтобы можно было получить эффективную оценку. Для этого в неравенстве Рао-Крамера нужно рассмотреть случай равенства (так как в этом случае оценка будет самой точной)

$$D_{\theta} \hat{\theta} = \frac{1}{I_n(\theta)}$$

Рассмотрим неравенство (1.10) и попытаемся понять, в каком случае в нём будет стоять знак равенства

$$\begin{aligned} 1 &= M_\theta \left[ \left( \hat{\theta} - \theta \right) \cdot U(\vec{x}, \theta) \right] = \\ &= \sqrt{M_\theta \left( \hat{\theta} - \theta \right)^2} \cdot \sqrt{M_\theta U(\vec{x}, \theta)^2} \end{aligned}$$

Снова проводим аналогию с векторами и видим, что скалярное произведение (математическое ожидание произведения) векторов (функций от параметра  $\theta$ :  $f_1(\theta) = \hat{\theta} - \theta$  и  $f_2(\theta) = U(\vec{x}, \theta)$ ) равно произведению их норм (корней квадратов математических ожиданий).

Это в свою очередь означает, что “угол” между этими векторами (функциями) равен нулю и эти функции являются линейными комбинациями друг друга. Значит, есть такая функция  $k(\theta)$ , что  $f_2(\theta)$  равняется произведению  $f_1(\theta)$  и  $k(\theta)$ .

$$\begin{aligned} U(\vec{x}, \theta) &= \left( \hat{\theta} - \theta \right) \cdot k(\theta) \\ \frac{\partial}{\partial \theta} \ln L(\vec{x}, \theta) &= \hat{\theta} \cdot k(\theta) - \theta \cdot k(\theta) \\ \partial \ln L(\vec{x}, \theta) &= \hat{\theta}(\vec{x}) \cdot k(\theta) \cdot \partial \theta - \theta \cdot k(\theta) \cdot \partial \theta \end{aligned}$$

Проинтегрируем обе части равенства

$$\int \partial \ln L(\vec{x}, \theta) = \hat{\theta}(\vec{x}) \cdot \int k(\theta) \partial \theta - \int \theta \cdot k(\theta) \partial \theta$$

Получим следующее равенство

$$\ln L(\vec{x}, \theta) + c_1(\vec{x}) = \hat{\theta}(\vec{x}) \cdot [a(\theta) + c_2] - [b^*(\theta) + c_3]$$

Сгруппируем константы и введём замену  $b(\theta) = -b^*(\theta)$

$$\ln L(\vec{x}, \theta) = \hat{\theta}(\vec{x}) \cdot a(\theta) + b(\theta) + c(\vec{x})$$

Избавимся от логарифма слева, а для этого проэкспонируем обе части равенства

$$L(\vec{x}, \theta) = \exp \left\{ \hat{\theta}(\vec{x}) \cdot a(\theta) + b(\theta) + c(\vec{x}) \right\}$$

При конечном  $n$  положим такую плотность распределения

$$p(x_1, \theta) = \exp \left\{ \hat{\theta}(x_1) \cdot a_1(\theta) + b_1(\theta) + c_1(x_1) \right\}$$

В таком случае получим следующую функцию правдоподобия

$$\begin{aligned} L(\vec{x}, \theta) &= \prod_{k=1}^n p(x_k, \theta) = \\ &= \exp \left\{ \sum_{k=1}^n \hat{\theta}(x_k) \cdot a_1(\theta) + n \cdot b_1(\theta) + \sum_{k=1}^n c_1(x_k) \right\} \end{aligned}$$

*распределение!экспоненциальное* Отметим, что в этом случае оценка  $\hat{\theta}(\vec{x})$  является суммой оценок по каждой координате (случайной величине)

$$\hat{\theta}(\vec{x}) = \sum_{k=1}^n \hat{\theta}(x_k)$$

**Определение 1.2.5** (Экспоненциальное распределение). *Распределения следующего вида называются экспоненциальными*

$$p(x, \theta) = \exp \left\{ \hat{\theta}(x) \cdot a(\theta) + b(\theta) + c(x) \right\}$$

Попробуем найти рецепт выяснения эффективной оценки. Начнём с примера

**Пример 1.2.1.** *Есть выборка  $x_1, x_2, \dots, x_n$  из нормального распределения с неизвестным математическим ожиданием  $N(\theta, 1)$ . Тогда плотность распределения  $k$ -ой случайной величины будет следующей*

$$p(x_k) = \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} \cdot \exp \left\{ -\frac{(x_k - \theta)^2}{2} \right\}$$

Её логарифм, очевидно, имеет такой вид

$$\ln p(x_k) = \ln \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} - \frac{(x_k - \theta)^2}{2}$$

Теперь выпишем логарифм функции правдоподобия

$$\begin{aligned} \ln L(\vec{x}, \theta) &= \sum_{k=1}^n \ln p(x_k) = \\ &= \sum_{k=1}^n \ln \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} - \sum_{k=1}^n \frac{(x_k - \theta)^2}{2} = \\ &= n \cdot \ln \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} - \sum_{k=1}^n \frac{(x_k - \theta)^2}{2} \end{aligned}$$

Раскроем скобки

$$\ln L(\vec{x}, \theta) = n \cdot \ln \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} - \sum_{k=1}^n \frac{x_k^2}{2} + \sum_{k=1}^n x_k \cdot \theta - \frac{n \cdot \theta^2}{2}$$

Воспользуемся формулой для несмещённой (ещё и эффективной) оценки среднего

$$\begin{aligned} \sum_{k=1}^n x_k \cdot \theta &= \frac{1}{n} \cdot \sum_{k=1}^n x_k \cdot \theta \cdot n = \bar{x} \cdot \theta \cdot n \\ \Rightarrow \ln L(\vec{x}, \theta) &= n \cdot \ln \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} - \sum_{k=1}^n \frac{x_k^2}{2} + \bar{x} \cdot \theta \cdot n - \frac{n \cdot \theta^2}{2} \end{aligned}$$

Сгруппировав множители  $n$ , получаем

$$\ln L(\vec{x}, \theta) = n \cdot \ln \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} - \sum_{k=1}^n \frac{x_k^2}{2} - n \cdot \frac{\theta^2 - 2 \cdot \bar{x} \cdot \theta}{2}$$

оценка!максимального  
правдоподобия  
уравнение!правдоподобия

Добавим и отнимем в числителе дроби выборочное среднее

$$\ln L(\vec{x}, \theta) = n \cdot \ln \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} - \sum_{k=1}^n \frac{x_k^2}{2} - n \cdot \frac{\theta^2 - 2 \cdot \bar{x} \cdot \theta + (\bar{x}^2 - \bar{x}^2)}{2}$$

Теперь в числителе очевиден квадрат разности

$$\ln L(\vec{x}, \theta) = n \cdot \ln \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} - \sum_{k=1}^n \frac{x_k^2}{2} + n \cdot \frac{\bar{x}^2}{2} - n \cdot \frac{\theta^2 - 2 \cdot \bar{x} \cdot \theta + \bar{x}^2}{2}$$

Записываем квадрат разности короче, а выборочное среднее вносим под знак суммы

$$\ln L(\vec{x}, \theta) = n \cdot \ln \frac{1}{\sqrt{2 \cdot \pi}} - \sum_{k=1}^n \frac{x_k^2 - \bar{x}^2}{2} - n \cdot \frac{(\theta - \bar{x})^2}{2}$$

Видим, что последнее вычитаемое не может быть отрицательным, а когда оценка  $\theta$  равна выборочному среднему, то последнее слагаемое обращается в нуль, а сама функция правдоподобия в таком случае принимает максимальное значение.

Делаем предположение о том, как находить наилучшую оценку

$$Q_* = \arg \max_{\theta} \ln L(\vec{x}, \theta)$$

Оказывается, именно так она и находится.

**Определение 1.2.6** (Оценка максимального правдоподобия). Оценка максимального правдоподобия  $\theta_*$  — такое значение параметра  $\theta$ , при котором функция правдоподобия достигает своего максимального значения

$$Q_* = \arg \max_{\theta} \ln L(\vec{x}, \theta)$$

**Замечание 7.** Оценок максимального правдоподобия может быть несколько, а может не существовать ни одной.

**Определение 1.2.7** (Уравнение правдоподобия). Уравнением правдоподобия называется равенство вида

$$U(\vec{x}, \theta) = 0$$

Или же

$$\frac{\partial}{\partial \theta} \ln L(\vec{x}, \theta) = 0$$

**Замечание 8.** В гладком случае оценку  $\theta_*$  можно искать с помощью уравнения правдоподобия. Тем не менее, нужно помнить, что равенство первой производной нулю является лишь необходимым условием максимума, поэтому полученные результаты необходимо проверять.

вариационный ряд

**Определение 1.2.8** (Вариационный ряд). *Вариационный ряд выборки  $x_1, x_2, \dots, x_n$  — значения выборки, упорядоченные в порядке неубывания*

$$x_{(1)}, x_{(2)}, \dots, x_{(n)}, x_{(1)} = \min_k x_k$$

**Теорема 1.2.3.** *Если плотность  $p(x, \theta)$  непрерывна и дифференцируема по параметру  $\theta$ , а производная не равна нулю  $\frac{\partial}{\partial \theta} p(x, \theta) \neq 0$ , то оценка максимального правдоподобия состоятельна*

## Глава 2

# Достаточные статистики

### 2.1 Оптимальная оценка

**Определение 2.1.1** (Симметризация). Симметризация  $\Lambda$  оценки  $\hat{\theta}$  — среднее оценок  $\hat{\theta}$  для всевозможных перестановок  $\sigma \in S_n$  элементов выборки  $x_1, x_2, \dots, x_n$

$$\Lambda \hat{\theta} = \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} \hat{\theta}(x_{\sigma(1)}, x_{\sigma(2)}, \dots, x_{\sigma(n)})$$

**Лемма 2.1.1.** Для произвольной несмещённой оценки  $\hat{\theta}$  её симметризация  $\Lambda \hat{\theta}$  не хуже её самой в среднем квадратическом

$$M_{\theta} \hat{\theta} = \theta \Rightarrow \begin{cases} M_{\theta} \Lambda \hat{\theta} = M_{\theta} \hat{\theta} = \theta \\ D_{\theta} \Lambda \hat{\theta} \leq D_{\theta} \hat{\theta} \end{cases}$$

*Доказательство.* Берём  $x_1, x_2, \dots, x_n$  — независимые одинаково распределённые случайные величины.

Введём обозначения для более короткой записи используемых в доказательстве случайных векторов.

Вектор, состоящий из элементов выборки в их изначальном порядке, обозначим привычным  $\vec{x}$

$$(x_1, x_2, \dots, x_n) = \vec{x}$$

Вектор, состоящий из элементов, изменивших своё местоположение под влиянием перестановки  $\sigma$  (значение которой будет ясно из контекста), будем обозначать через  $\vec{x}_{\sigma}$

$$(x_{\sigma(1)}, x_{\sigma(2)}, \dots, x_{\sigma(n)}) = \vec{x}_{\sigma}$$

Тогда и оценки примут более красивый вид

$$\begin{aligned} \hat{\theta}(x_1, x_2, \dots, x_n) &= \hat{\theta}(\vec{x}) \\ \hat{\theta}(x_{\sigma(1)}, x_{\sigma(2)}, \dots, x_{\sigma(n)}) &= \hat{\theta}(\vec{x}_{\sigma}) \end{aligned}$$

Теперь приступим непосредственно к доказательству.

1. Начнём с первого пункта — докажем несмещённость симметризации оценки  $\hat{\theta}$ .

Нетрудно показать, что вектора  $\vec{x}$  и  $\vec{x}_\sigma$  имеют одинаковое распределение для любой перестановки  $\sigma$ , а это значит, что и оценки  $\hat{\theta}(\vec{x})$  и  $\hat{\theta}(\vec{x}_\sigma)$  распределены одинаково как функции случайных одинаково распределённых векторов. Следовательно, их математические ожидания равны между собой при любой перестановке  $\sigma$

$$M_\theta \hat{\theta}(\vec{x}) = M_\theta \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) = \theta$$

Посчитаем математическое ожидание симметризации оценки  $\hat{\theta}$

$$M_\theta \Lambda \hat{\theta} = M_\theta \left\{ \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) \right\}$$

Помним, что математическое ожидание линейно и константы можно выносить за знак математического ожидания, а математическое ожидание суммы равно сумме математических ожиданий

$$M_\theta \left\{ \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) \right\} = \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} M_\theta \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma)$$

Не забываем, что математическое ожидание оценки любого вектора  $\vec{x}_\sigma$  одинаково и равно параметру  $\theta$

$$\frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} M_\theta \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) = \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} \theta$$

Сумма имеет  $n!$  слагаемых (количество перестановок  $\sigma \in S_n$ )

$$\frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} \theta = \frac{1}{n!} \cdot n! \cdot \theta = \theta$$

А это значит, что первый пункт доказан и симметризация несмещённой оценки  $\hat{\theta}$  действительно несмещённая

$$M_\theta \Lambda \hat{\theta} = \theta$$

2. Теперь посмотрим, чему равна дисперсия симметризации оценки  $\hat{\theta}$

Воспользуемся определением

$$D_\theta \Lambda \hat{\theta} = M_\theta \left( \Lambda \hat{\theta} - \theta \right)^2 = M_\theta \left\{ \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \theta \right\}^2$$



Внесём параметр  $\theta$  в сумму. Для этого нужно умножить и поделить его на  $n!$  (так как сумма имеет  $n!$  слагаемых)

$$\begin{aligned}
 M_\theta \left\{ \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \theta \right\}^2 &= \\
 = M_\theta \left\{ \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \frac{1}{n!} \cdot n! \cdot \theta \right\}^2 &= \\
 = M_\theta \left\{ \frac{1}{n!} \cdot \left( \sum_{\sigma \in S_n} \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - n! \cdot \theta \right) \right\}^2 &= \\
 = M_\theta \left\{ \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} \left( \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \theta \right) \right\}^2 &= \\
 = M_\theta \left\{ \sum_{\sigma \in S_n} \frac{1}{n!} \cdot \left( \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \theta \right) \right\}^2
 \end{aligned}$$

Вспомним неравенство Йенсена для выпуклой функции  $f$

$$f\left(\sum_{i=1}^n q_i \cdot x_i\right) \leq \sum_{i=1}^n q_i \cdot f(x_i), \quad \sum_{i=1}^n q_i = 1$$

В нашем случае  $x_i = \left(\hat{\theta}(\vec{x}_{\sigma_i}) - \theta\right)$ , функция  $f(x) = x^2$ , сумма проходит по всевозможным перестановкам  $\sigma$ , а роль  $q_i$  выполняет  $\frac{1}{n!}$ , так как

$$\sum_{\sigma \in S_n} q_i = \sum_{\sigma \in S_n} \frac{1}{n!} = n! \cdot \frac{1}{n!} = 1$$

Перепишем неравенство Йенсена для нашего случая

$$M_\theta \left\{ \sum_{\sigma \in S_n} \frac{1}{n!} \cdot \left( \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \theta \right) \right\}^2 \leq M_\theta \sum_{\sigma \in S_n} \frac{1}{n!} \cdot \left( \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \theta \right)^2 \quad (2.1)$$

Воспользуемся линейностью математического ожидания, внеся его под знак суммы

$$M_\theta \sum_{\sigma \in S_n} \frac{1}{n!} \cdot \left( \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \theta \right)^2 = \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} M_\theta \left( \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \theta \right)^2$$

Видим сумму дисперсий. Дисперсии одинаковы, так как оценки имеют одинаковые распределения

$$\begin{aligned}
 \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} M_\theta \left( \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) - \theta \right)^2 &= \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} D_\theta \hat{\theta}(\vec{x}_\sigma) = \\
 = \frac{1}{n!} \cdot \sum_{\sigma \in S_n} D_\theta \hat{\theta}(\vec{x}) &= \frac{1}{n!} \cdot n! \cdot D_\theta \hat{\theta}(\vec{x}) = D_\theta \hat{\theta}(\vec{x})
 \end{aligned}$$

функция!вариационного  
ряда  
сигма-  
алгебра!порождённая  
случайной величиной  
Сигма-алгебра,  
порождённая случайной  
величиной

Из неравенства Йенсена (2.1) видим, что дисперсия симметризации не хуже дисперсии самой оценки

$$D_{\theta} \Lambda \hat{\theta} \leq D_{\theta} \hat{\theta}(\vec{x})$$

То есть, симметризация не ухудшает оценку, а в общем случае (когда неравенство строгое) даже делает её лучше.  $\square$

**Замечание 9.** Равенство в неравенстве Йенсена (в доказательстве выше) возможно только в случае симметричной функции. Значит, в качестве оценки достаточно брать только симметричные функции выборки

**Определение 2.1.2** (Функция вариационного ряда). Если оценка  $\hat{\theta}$  симметрична относительно перестановок аргументов, то она является функцией вариационного ряда

**Замечание 10.** Все оценки, которые претендуют быть оптимальными, должны быть функциями вариационного ряда

## 2.2 Условное математическое ожидание и условные распределения

### 2.2.1 $\sigma$ -алгебра, порождённая случайной величиной

Имеем вероятностное пространство  $(\Omega, \mathfrak{F}, \mathbb{P})$ , также есть функция  $\xi : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$  такая, что связанные с ней множества измеримы по Лебегу

$$\{\omega \mid \xi(\omega) < c\} \in \mathfrak{F}, c \in \mathbb{R}$$

Но это будет неудобно при использовании, поэтому возьмём борелевские подмножества  $\mathfrak{B}$  множества  $\mathbb{R}$

$$\mathbb{R} \supset \mathfrak{B} \ni \Delta : \xi^{-1}(\Delta) \in \mathfrak{F}$$

Рассмотрим более подробно, что же означает запись  $\xi^{-1}(\Delta)$

$$\xi^{-1}(\Delta) = \{\omega \mid \xi(\omega) \in \Delta\}, \quad \Delta \in \mathfrak{B}, \omega \in \Omega$$

**Определение 2.2.1** (Сигма-алгебра, порождённая случайной величиной).  $\mathfrak{F}_{\xi} = \sigma(\xi)$  —  $\sigma$ -алгебра, порождённая случайной величиной  $\xi$

$$\mathfrak{F}_{\xi} = \{\xi^{-1}(\Delta) \mid \Delta \in \mathfrak{B}\}$$

Из курса теории вероятностей помним лемму, которая утверждает, что  $\xi$  — случайная величина тогда и только тогда, когда

$$\forall \Delta \in \mathfrak{B} : \{\omega \mid \xi(\omega) \in \Delta\} = \{\xi \in \Delta\} = \xi^{-1}(\Delta) \in \mathfrak{F}$$

А это значит, что все элементы  $\sigma$ -алгебры  $\mathfrak{F}_{\xi}$  входят в  $\sigma$ -алгебру  $\mathfrak{F}$ , а сама  $\mathfrak{F}_{\xi}$  является подмножеством  $\mathfrak{F}$

$$\begin{cases} \mathfrak{F}_{\xi} = \{\xi^{-1}(\Delta) \mid \Delta \in \mathfrak{B}\} \\ \forall \Delta \in \mathfrak{B} : \xi^{-1}(\Delta) \in \mathfrak{F} \end{cases} \Rightarrow \mathfrak{F}_{\xi} \subset \mathfrak{F}$$

Проверим, что  $\mathfrak{F}_{\xi}$  действительно является  $\sigma$ -алгеброй

1. Множество элементарных исходов  $\Omega$  входит в  $\mathfrak{F}_\xi$ . Поскольку случайная величина  $\xi$  принимает действительные значения, то прообраз множества действительных чисел  $\mathbb{R}$  и будет множеством элементарных исходов  $\Omega$ . А поскольку  $\mathbb{R}$  принадлежит борелевской  $\sigma$ -алгебре, то его прообраз по определению принадлежит  $\sigma$ -алгебре  $\mathfrak{F}_\xi$

$$\begin{cases} \xi^{-1}(\Delta \in \mathfrak{B}) \in \mathfrak{F} \\ \mathbb{R} \in \mathfrak{B} \\ \xi^{-1}(\mathbb{R}) = \Omega \end{cases} \Rightarrow \Omega \in \mathfrak{F}_\xi$$

2. Если событие  $A$  принадлежит  $\mathfrak{F}_\xi$ , то его дополнение  $\bar{A}$  тоже принадлежит  $\mathfrak{F}_\xi$

$$\begin{aligned} A &= \xi^{-1}(\Delta) = \{\omega \mid \xi(\omega) \in \Delta\} \\ \Rightarrow \bar{A} &= \{\omega \mid \xi(\omega) \notin \Delta\} = \{\omega \mid \xi(\omega) \in \bar{\Delta}\} \\ \bar{A} &= \xi^{-1}(\bar{\Delta}) \end{aligned}$$

Поскольку  $\mathfrak{B}$  является  $\sigma$ -алгеброй, а  $\Delta$  — её элемент, то дополнение  $\bar{\Delta}$  тоже принадлежит  $\sigma$ -алгебре  $\mathfrak{B}$ . Из этого следует, что свойство выполняется

$$\begin{cases} \xi^{-1}(\Delta) \in \mathfrak{F} \\ \Delta \in \mathfrak{B} \Rightarrow \bar{\Delta} \in \mathfrak{B} \end{cases} \Rightarrow \overline{\xi^{-1}(\Delta)} = \xi^{-1}(\bar{\Delta}) \in \mathfrak{F}$$

3. Замкнутость относительно счётных пересечений.

Начнём с замкнутости относительно пересечения двух множеств

$$A = \xi^{-1}(\Delta_1), B = \xi^{-1}(\Delta_2)$$

Начинаем считать

$$\begin{aligned} A \cap B &= \xi^{-1}(\Delta_1) \cap \xi^{-1}(\Delta_2) = \\ &= \{\omega \mid \xi(\omega) \in \Delta_1\} \cap \{\omega \mid \xi(\omega) \in \Delta_2\} = \\ &= \{\omega \mid \xi(\omega) \in \Delta_1 \wedge \xi(\omega) \in \Delta_2\} = \\ &= \{\omega \mid \xi(\omega) \in \Delta_1 \cap \Delta_2\} = \xi^{-1}(\Delta_1 \cap \Delta_2) \end{aligned}$$

Значит, имеем равенство

$$\xi^{-1}(\Delta_1) \cap \xi^{-1}(\Delta_2) = \xi^{-1}(\Delta_1 \cap \Delta_2)$$

Пользуясь методом математической индукции нетрудно показать, что для любого  $n$  выполняется

$$\xi^{-1}\left(\bigcap_{i=1}^n \Delta_i\right) = \bigcap_{i=1}^n \xi^{-1}(\Delta_i), \Delta_i \in \mathfrak{B}$$

множество уровня  
случайная  
величина измеримая  
относительно  
сигма-алгебры

Как устроена эта  $\sigma$ -алгебра? Каждому элементарному исходу отвечает одно и только одно значение случайной величины, а каждому значению случайной величины отвечает один и больше элементарных исходов. Допустим, есть некое  $a \in \mathbb{R}$ , которое является образом по крайней мере двух элементарных исходов  $\omega_1$  и  $\omega_2$

$$\xi(\omega_1) = \xi(\omega_2) = a$$

Теперь рассмотрим элемент  $\Delta$  борелевской  $\sigma$ -алгебры  $\mathfrak{B}$ . Из вышесказанного следует, что, если число  $a$  принадлежит множеству  $\Delta$ , то прообраз этого множества содержит элементы  $\omega_1$  и  $\omega_2$ , в противном случае оба элементарных исхода не входят в прообраз

$$\begin{aligned} a \in \Delta &\Rightarrow \xi^{-1}(\Delta) \ni \omega_1, \omega_2 \\ a \notin \Delta &\Rightarrow \xi^{-1}(\Delta) \not\ni \omega_1, \omega_2 \end{aligned}$$

То есть, множество  $\mathfrak{F}_\xi$  не будет различать элементы  $\omega_1$  и  $\omega_2$ . Это в свою очередь означает, что можно разбить  $\mathfrak{F}_\xi$  на уровни — непересекающиеся подмножества

**Определение 2.2.2** (Множество уровня). *Множество уровня  $H_t$  — полный прообраз значения  $t \in \mathbb{R}$  случайной величины  $\xi$*

$$H_t = \{\omega \mid \xi(\omega) = t\} = \xi^{-1}(t)$$

**Замечание 11.** Уровни  $H_i$  составляют разбиение множества элементарных исходов  $\Omega$ .

1. Множества  $H_i$  не пересекаются

$$H_{t_1} \neq H_{t_2} \Leftrightarrow t_1 \neq t_2$$

2. Объединение всех  $H_i$  даёт множество элементарных исходов

$$\bigcup_{t \in \mathbb{R}} H_t = \bigcup_{t \in \mathbb{R}} \xi^{-1}(t) = \xi^{-1}(\mathbb{R}) = \Omega$$

Очень похоже на гипотезы из курса теории вероятностей с той лишь разницей, что уровней может быть бесконечное и даже континуальное количество, из чего также следует, что вероятность некоторых из них может быть нулевой.

### 2.2.2 Случайная величина, измеримая относительно $\sigma$ -алгебры, порождённой случайной величиной

В общем случае вероятностное пространство может быть разбито на континуальное количество множеств уровней.

Начнём же с рассмотрения того случая, когда случайная величина  $\xi$  принимает  $n$  значений:  $a_1, a_2, \dots, a_n$

$$\xi : \Omega \rightarrow \{a_1, a_2, \dots, a_n\}$$

Это в свою очередь означает, что у нас есть  $n$  уровней

$$H_k = \{\omega \mid \xi(\omega) = a_k\}, k = \overline{1, n}$$

Нетрудно понять, что  $\sigma$ -алгебра  $\sigma(\xi)$  содержит  $2^n$  элементов

$$\sigma(\xi) = \left\{ \bigcup_{k=1}^n H_k^{\eta_k} \mid \eta_k = \overline{0, 1}, H_k^0 = \emptyset, H_k^1 = H_k \right\}$$

Нам нет смысла пользоваться лишь одной случайной величиной  $\xi$ . Нас интересует, как устроены случайные величины, которые измеримы относительно  $\sigma$ -алгебры  $\sigma(\xi)$ . Возьмём  $\varkappa$  — случайная величина, измеримая относительно  $\sigma(\xi)$ . Это значит, что все прообразы случайной величины  $\varkappa$  должны лежать в  $\sigma$ -алгебре  $\sigma(\xi)$

$$\{\omega \mid \varkappa(\omega) \leq c\} \in \sigma(\xi)$$

То есть, прообразы  $\varkappa$  выражаются через объединения уровней  $H_k$

$$\{\omega \mid \varkappa(\omega) \leq c\} = \bigcup_{k=1}^n H_k^{\eta_k}$$

Введём обозначение

$$A(c) = \{\omega \mid \varkappa(\omega) \leq c\}$$

Очевидно, что при  $c \rightarrow -\infty$  прообразом является пустое множество, а когда  $c \rightarrow +\infty$ , то прообразом является всё множество элементарных исходов

$$\begin{aligned} \{\omega \mid \varkappa(\omega) \leq -\infty\} &= \{\omega \mid \varkappa(\omega) \in \emptyset\} = \varkappa^{-1}(\emptyset) = \emptyset \\ \{\omega \mid \varkappa(\omega) \leq +\infty\} &= \{\omega \mid \varkappa(\omega) \in \mathbb{R}\} = \varkappa^{-1}(\mathbb{R}) = \Omega \end{aligned}$$

Также ясно, что, если имеются два элемента борелевского множества и один включён в другой, то полный прообраз первого элемента тоже будет включён в прообраз второго

$$\begin{aligned} \Delta_1, \Delta_2 \in \mathfrak{B}, \Delta_1 \subseteq \Delta_2 \\ \Rightarrow \varkappa^{-1}(\Delta_1) \subseteq \varkappa^{-1}(\Delta_1) \cup \varkappa^{-1}(\Delta_2) = \\ = \varkappa^{-1}(\Delta_1 \cup \Delta_2) = \varkappa^{-1}(\Delta_2) \end{aligned}$$

Ни у кого не возникает сомнений, что справедливо и такое утверждение

$$c_1, c_2 \in \mathbb{R}, c_1 \leq c_2 \Rightarrow A(c_1) \subseteq A(c_2)$$

Объединим и проанализируем вышеописанное:

1. Количество элементов в множестве  $A(c)$  не уменьшается с ростом  $c$

$$c_1 \leq c_2 \Rightarrow A(c_1) \subseteq A(c_2)$$

2. Множество  $A(c)$  “разрастается” от пустого множества  $\emptyset$  до множества элементарных событий  $\Omega$  с ростом  $c$  от  $-\infty$  до  $+\infty$

$$A(-\infty) = \emptyset, A(+\infty) = \Omega$$

3. Множество  $A(c)$  растёт дискретными шагами. Это связано с тем, что уровни  $H_k$  в нашей  $\sigma$ -алгебре неделимы, а каждый её элемент должен состоять из объединений этих уровней и ничего другого.

Из этого всего делаем более конкретные выводы о том, как изменяется значение функции  $A(c)$  с ростом параметра  $c$ . Должны быть опорные точки, на которых происходит “скачок” — точки, на которых к объединению добавляется ещё один или более уровней.

Поскольку имеется  $n$  уровней, то может быть не более  $n$  скачков: ведь самый “медленный” рост будет происходить, если добавлять по одному уровню на определённых константах, а нужно пройти всё от пустого множества  $\emptyset$  до множества элементарных исходов  $\Omega$ .

Выделим  $m$  точек ( $m \leq n$ )  $c_1 < c_2 < \dots < c_m$  на числовой прямой  $\mathbb{R}$  как значения случайной величины  $\varkappa$

$$\varkappa : \Omega \rightarrow \{c_1, c_2, \dots, c_m\}$$

Посмотрим, как соотносятся между собой  $A(c_i)$  и  $A(c_{i-1})$ , чтобы лучше понять природу скачков.

Сначала покажем, что  $A(c_1)$  является прообразом  $c_1$

$$\varkappa^{-1}(c_1) = \{\omega \mid \varkappa(\omega) = c_1\}$$

Поскольку случайная величина не принимает значений до  $c_1$ , то множество  $A(c_1 - 0) = \{\omega \mid \varkappa(\omega) < c_1\}$  пустое. Получаем то, что хотели

$$\begin{aligned} \varkappa^{-1}(c_1) &= \{\omega \mid \varkappa(\omega) = c_1\} \cup \emptyset = \\ &= \{\omega \mid \varkappa(\omega) = c_1\} \cup \{\omega \mid \varkappa(\omega) < c_1\} = \\ &= \{\omega \mid \varkappa(\omega) \leq c_1\} = A(c_1) \end{aligned}$$

Идём дальше. Обозначим  $c_0 = -\infty$ . Тогда в каждой точке  $A(c_i)$ ,  $i = \overline{1, m}$  происходит скачок на множество  $\varkappa^{-1}(c_i)$ , то есть

$$A(c_i) = A(c_{i-1}) \cup \varkappa^{-1}(c_i)$$

Так происходит, потому что имеет место равенство, которое выполняется из-за того, что функция имеет скачки лишь на параметрах  $c_i$ , а между ними не меняет значения

$$A(c_i) = A(c_{i+1} - 0)$$

В таком случае тождество очевидно

$$\begin{aligned} A(c_i) &= \{\omega \mid \varkappa(\omega) \leq c_i\} = \\ &= \{\omega \mid \varkappa(\omega) < c_i\} \cup \{\omega \mid \varkappa(\omega) = c_i\} = \\ &= A(c_{i-1} - 0) \cup \varkappa^{-1}(c_i) = A(c_{i-1}) \cup \varkappa^{-1}(c_i) \end{aligned}$$

Поскольку  $\varkappa$  — случайная величина, принимающая  $m$  значений, то её прообразы составляют разбиение пространства элементарных исходов  $\Omega$ . А поскольку  $A(c_{i-1})$  состоит из объединений этих прообразов, то оно не пересекается с  $\varkappa^{-1}(c_i)$ . Это в свою очередь означает, что мы знаем, как вычислять прообраз  $\varkappa$

$$\begin{cases} A(c_{i-1}) \cap \varkappa^{-1}(c_i) = \emptyset \\ A(c_i) = A(c_{i-1}) \cup \varkappa^{-1}(c_i) \end{cases} \Rightarrow \varkappa^{-1}(c_i) = A(c_i) \setminus A(c_{i-1})$$

Это в свою очередь означает, что случайная величина  $\varkappa$  принимает значение  $c_i$  при выпадении любого элементарного исхода  $\omega$  из множества  $A(c_i) \setminus A(c_{i-1})$

$$\varkappa(\omega) = c_i : \omega \in A(c_i) \setminus A(c_{i-1})$$

Запишем это в более удобном виде

$$\varkappa(\omega) = \sum_{i=1}^m c_i \cdot \mathbb{1}\{\omega \in A(c_i) \setminus A(c_{i-1})\}$$

Но эта сумма кажется уродливой из-за длинного индикатора и непонятного  $m$ . Попытаемся разобраться, в чём же дело и как прийти к изначальной  $n$  и милым  $H_k$ .

Помним, что  $A(c_i) \setminus A(c_{i-1})$  — объединение нескольких множеств уровня  $H_k$ .

Предположим, есть некое  $t$  такое, что  $A(c_t) \setminus A(c_{t-1})$  является объединением двух (нетрудно показать, что для любого количества, в том числе и одного) уровней, которые обозначим  $H_1^t$  и  $H_2^t$ . Тогда  $t$ -ое слагаемое примет следующий вид

$$c_t \cdot \mathbb{1}\{\omega \in A(c_t) \setminus A(c_{t-1})\} = c_t \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_1^t \cup H_2^t\}$$

Поскольку уровни не пересекаются, то можно разбить индикатор на сумму

$$\begin{aligned} c_t \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_1^t \cup H_2^t\} &= c_t \cdot (\mathbb{1}\{\omega \in H_1^t\} + \mathbb{1}\{\omega \in H_2^t\}) \\ &= c_t \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_1^t\} + c_t \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_2^t\} \end{aligned}$$

Если ввести две константы  $c_1^t$  и  $c_2^t$ , которые будут равны старой  $c_t$ , то равенство примет более симпатичный вид

$$c_t \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_1^t\} + c_t \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_2^t\} = c_1^t \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_1^t\} + c_2^t \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_2^t\}$$

Таким же образом можно поступить со всеми объединениями. В итоге получим  $n$  констант  $d_1, d_2, \dots, d_n$  вместо  $m$   $c_1, c_2, \dots, c_m$ .

Теперь сумма примет более приятный для глаз и понятный из контекста начала раздела вид

$$\begin{aligned} \varkappa(\omega) &= \sum_{i=1}^m c_i \cdot \mathbb{1}\{\omega \in A(c_i) \setminus A(c_{i-1})\} \\ &= \sum_{i=1}^n d_i \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_i\} \end{aligned}$$

математическое  
ожидаие!условное  
условное математическое  
ожидаие

Видим, что теперь можно определить отображение из множества значений, принимаемых случайной величиной  $\xi$ , в множество значений, принимаемых случайной величиной  $\varkappa$

$$f : \{a_1, a_2, \dots, a_n\} \rightarrow \{d_1, d_2, \dots, d_n\}$$

Попробуем показать, что  $\varkappa$  является функцией от  $\xi$ . Очевидно, что случайная величина  $\xi$  имеет такой же вид, что и  $\varkappa$  — сумма с константами и индикаторами

$$f(\xi(\omega)) = f\left(\sum_{i=1}^n a_i \cdot \mathbb{1}\{\omega \in H_i\}\right)$$

Поскольку уровни  $H_i$  не пересекаются, то лишь одно слагаемое не будет равно нулю:  $\omega$  может принадлежать лишь одному уровню. В таком случае запись принимает свой первый вид

$$f(\xi(\omega)) = f(a_i) : \omega \in H_i$$

Замечаем, что  $f(a_i) = d_i$ , а это и есть то значение, которое принимает случайная величина  $\varkappa$  на уровне  $H_i$

$$f(\xi(\omega)) = f(a_i) = d_i = \varkappa(\omega) : \omega \in H_i$$

Поскольку мы не привязывались к конкретным  $i$  и конкретным  $\omega$ , то получаем желаемое равенство

$$\varkappa = f(\xi)$$

Отсюда делаем вывод, что случайной величине  $\varkappa$  необходимо и достаточно быть функцией случайной величины  $\xi$ , чтобы быть измеримой относительно  $\sigma$ -алгебры  $\sigma(\xi)$ , порождённой случайной величиной  $\xi$

### 2.2.3 Условное математическое ожидание

#### Проекция



# Литература

- [1] Боровков А. А. Математическая статистика. Санкт-Петербург: Лань, 2010. 705 с.

# Предметный указатель

- Сигма-алгебра, порождённая случайной величиной, 26
- функция
  - правдоподобия, 14
  - вариационного ряда, 26
- функция распределения
  - эмпирическая, 3
  - неизвестная, 3
  - выборочная, 3
- гистограмма, 5
- количество информации Фишера, 16
- математическое ожидание
  - условное, 32
- множество уровня, 28
- неизвестный параметр, 8
- неравенство
  - Рао-Крамера, 16
- оценка, 8
  - эффективная, 18
  - максимального правдоподобия, 21
  - несмещённая, 10
  - сильно состоятельная, 9
  - состоятельная, 9
- распределение
  - экспоненциальное, 20
- сигма-алгебра
  - порождённая случайной величиной, 26
- симметризация, 23
- случайная величина
  - измеримая относительно сигма-алгебры, 28
- статистика, 8
- теорема
  - Колмогорова, 12
- уравнение
  - правдоподобия, 21
- условное математическое ожидание, 32
- вариационный ряд, 22
- выборочная дисперсия, 12
- выборочное среднее, 12
- вклад выборки, 15

# Оглавление

<b>1</b>	<b>Основы</b>	<b>3</b>
1.1	Методы оценок характеристик распределения наблюдаемых случайных величин . . . . .	3
1.1.1	Эмпирическая функция распределения . . . . .	3
1.1.2	Гистограмма . . . . .	4
1.1.3	Оценка неизвестных параметров . . . . .	8
1.1.4	Выборочные оценки. Метод моментов . . . . .	10
1.2	Свойства оценок . . . . .	12
1.2.1	Неравенство Рао-Крамера . . . . .	12
1.2.2	Метод максимального правдоподобия . . . . .	18
<b>2</b>	<b>Достаточные статистики</b>	<b>23</b>
2.1	Оптимальная оценка . . . . .	23
2.2	Условное математическое ожидание и условные распределения	26
2.2.1	$\sigma$ -алгебра, порождённая случайной величиной . . . . .	26
2.2.2	Случайная величина, измеримая относительно $\sigma$ -алгебры, порождённой случайной величиной . . . . .	28
2.2.3	Условное математическое ожидание . . . . .	32