



## Задача оценивания неизвестных параметров. Несмещенность, состоятельность оценок.

Def Статистика – любая функция от выборки.

Пусть дана выборка из распределения с неизвестным параметром. Точно узнать его невозможно. Однако можно приблизить.

Def Оценкой неизвестного параметра  $\theta$  наз. любая функция от выборки  $\theta^* = g(x_1, \dots, x_n)$  в том или ином смысле приближающая  $\theta$ .

Def Оценка  $\theta^*$  наз. несмещенной, если  $E\theta^* = \theta$

Def Оценка  $\theta^*$  наз. состоятельной, если  $\theta^* \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{} \theta$

miro