Анонс занятия “ТеорВер“ - 11

Оценка параметра распределения. Функция правдоподобия. Метод максимального правдоподобия. Информация Фишера. Оценка для эффективной статистики: неравенство Рао-Крамера

На этом занятии мы познакомимся с методом максимального правдоподобия. Это - важнейший метод в математической статистике. Он используется и для того, чтобы построить эффективную оценку параметра и для сравнения качества моделей, для того, чтобы выбрать лучшую модель (критерий AIC).

Также познакомимся с информацией Фишера, которая нужна, чтобы оценить информацию, получаемую от одного наблюдения при данном параметре распределения. С помощью информации Фишера мы сможем оценить снизу дисперсию самой эффективной оценки параметра.