Анонс занятия “ТеорВер“ - 12

На этом занятии мы познакомимся с информацией Фишера, которая нужна, чтобы оценить информацию, получаемую от одного наблюдения при данном параметре распределения. Чем проще определить параметр распределения с помощью наблюдений (чем меньше дисперсия самой эффективной оценки), тем больше информации Фишера, тем ценнее наблюдение СВ.

С использованием информации Фишера мы сможем оценить снизу дисперсию самой эффективной оценки параметра на основе неравенства Рао-Крамера. Рассмотрим примеры оценки информации Фишера и оценки эффективности известных нам выборочных оценок параметров генерального среднего и дисперсии.