

Clase 04:

- Parámetro estimable.
- EIVMU
- Información de Fisher.
- Cota Mínima y eficiencia.

Estimador Puntual

$$T: \mathcal{A} \rightarrow \Theta$$

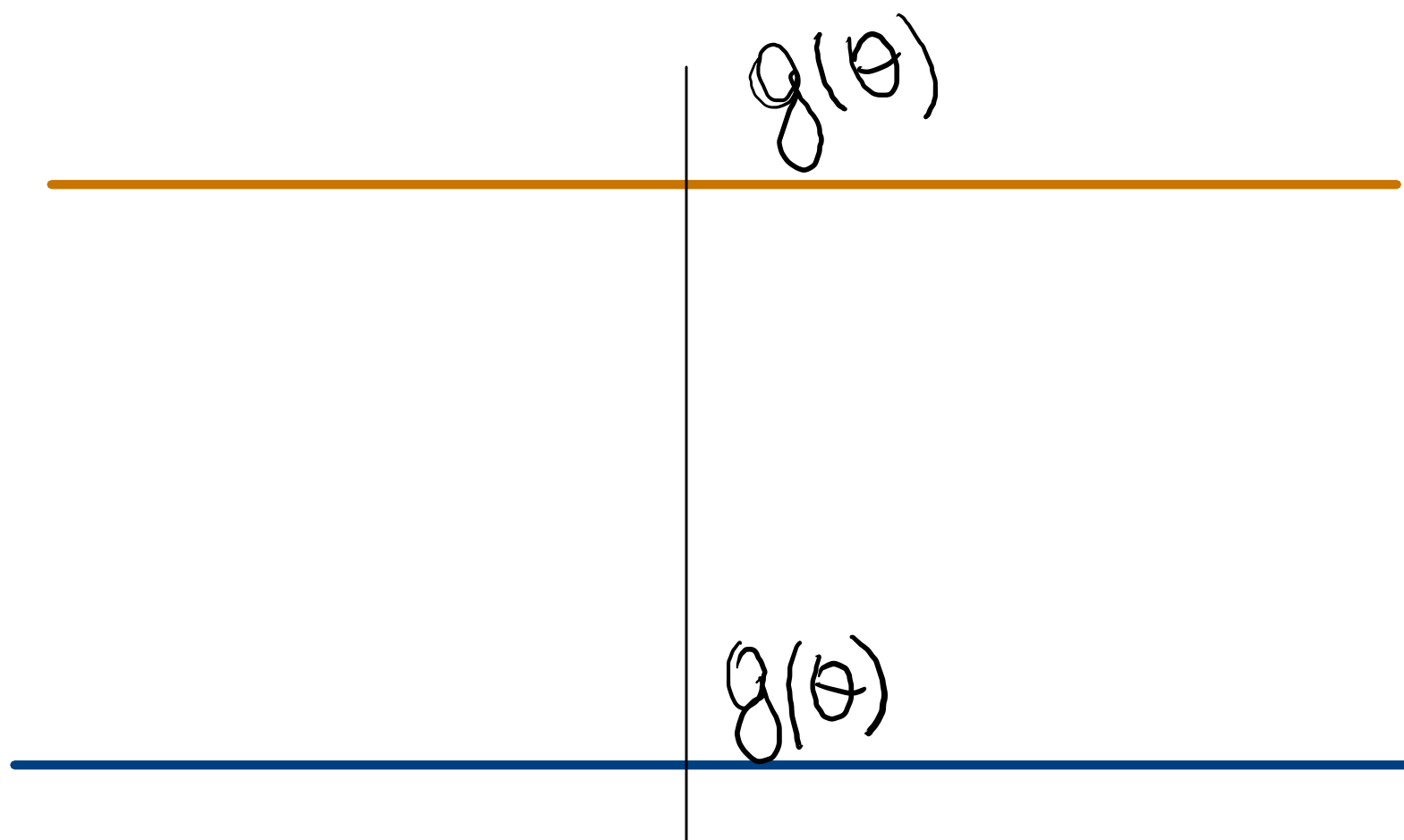
$$x \mapsto T(x) = \theta,$$

Ejemplo de regresión lineal simple

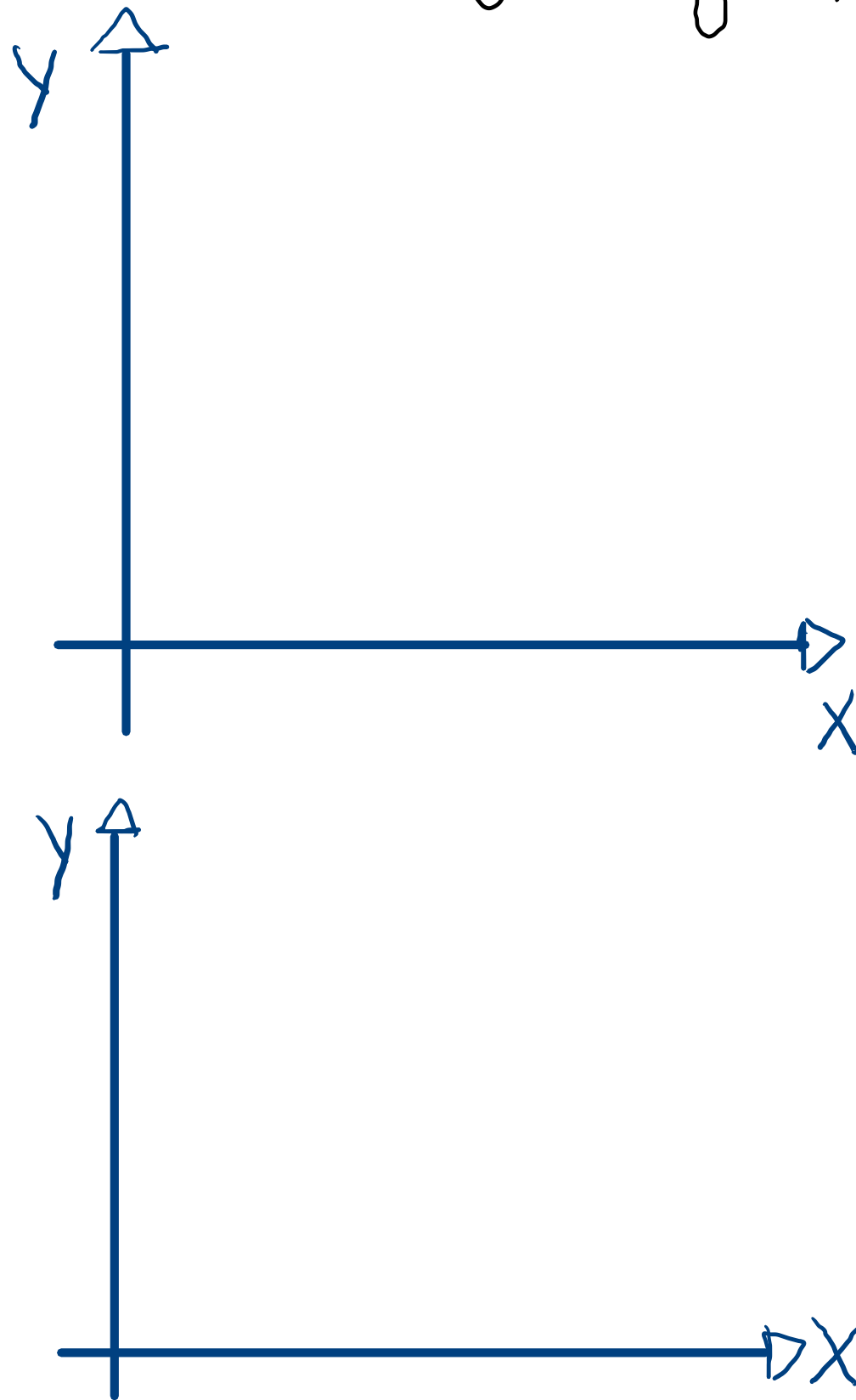
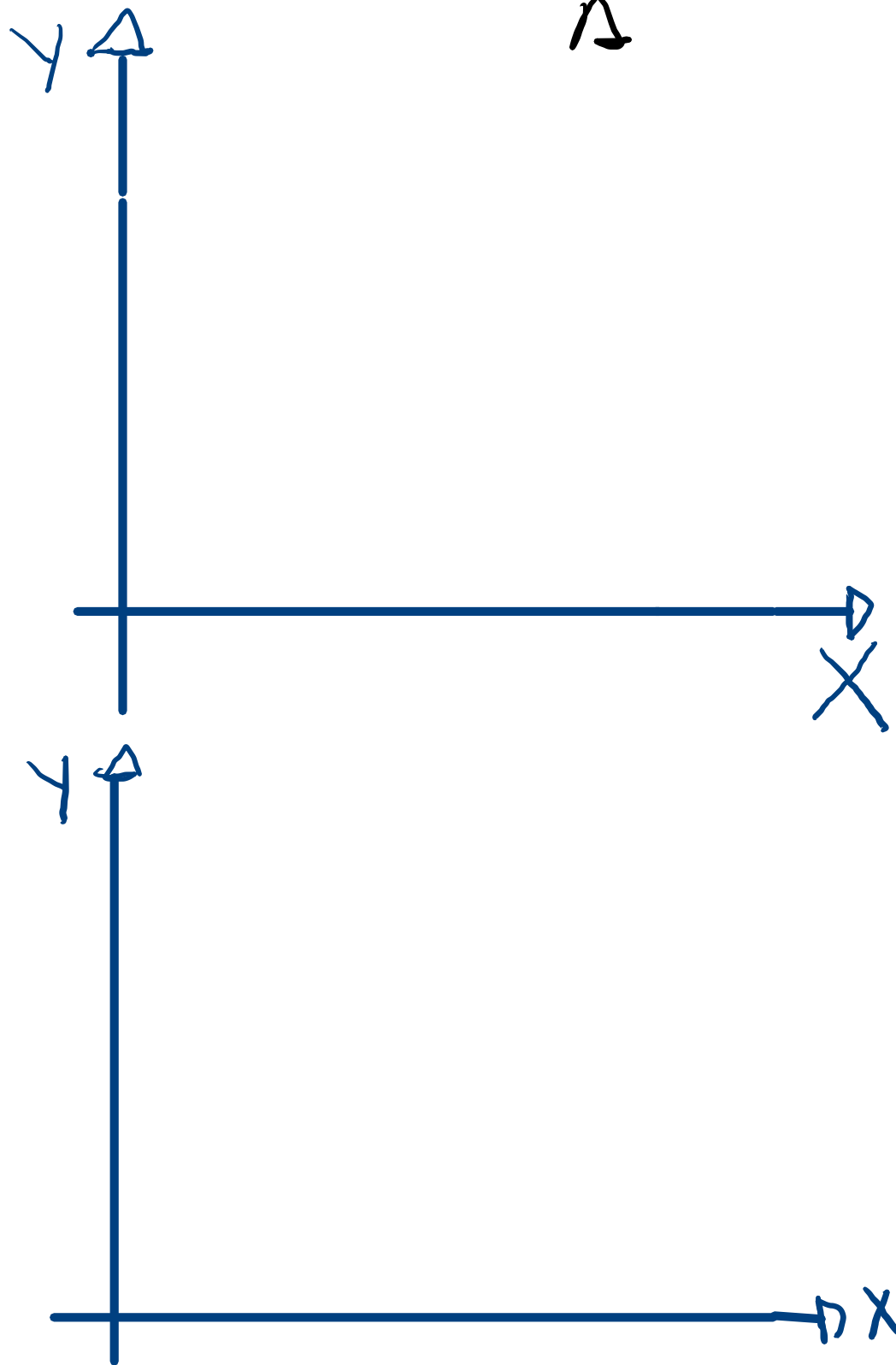
Media posteriori

Medida frecuentista aleatoria

Evaluación frecuentista de $T(x)$



$$T: \underbrace{\mathbb{R} \times \mathbb{R}}_{\Lambda} \rightarrow \mathbb{R} (\oplus); (x, y) \rightarrow g(\theta)$$



Caso especial: pérdida cuadrática y estimador insesgado

Función de log-verosimilitud

Función escore e Información de Fisher

Información de Fisher caso independiente

Información de Fisher caso i.i.d