

Estimación Máxima Probabilidad (EM) (Fisher)

ε.δ. x_1, x_2, \dots, x_n από $f(x, \theta), \theta \in \Theta \subseteq \mathbb{R}^r$

Έστω x_1, x_2, \dots, x_n η παρατηρηθείσα τιμή του ε.δ.

$f(x, \theta) = f(x_1, \dots, x_n, \theta) = \prod_{i=1}^n f(x_i, \theta)$

η απόσταση των

παρατηρηθέντων $i=1$
από το θ με τον μέσο όρο

$\approx P_0(x_1 - \epsilon_1 \leq x_1 \leq x_1 + \epsilon_1, \dots, x_n - \epsilon_n \leq x_n \leq x_n + \epsilon_n)$

ΟΡΙΣΜΟΣ 1 (Συνάρτηση Πιθανοφάνειας)

Έστω ε.δ. x_1, \dots, x_n από κατανομή $f(x, \theta), \theta \in \Theta \subseteq \mathbb{R}^r$. Έστω x_1, \dots, x_n η παρατηρηθείσα τιμή του ε.δ. Η συνάρτηση πιθανοφάνειας ή πιθανοφάνεια του x_1, \dots, x_n ορίζεται:

$L(\theta) = L(\theta | x) \stackrel{\text{def}}{=} f(x_1, \dots, x_n, \theta) = \prod_{i=1}^n f(x_i, \theta), \theta \in \Theta$

ΟΡΙΣΜΟΣ 2 ΕΜΠ Έστω $L(\theta) = L(\theta | x)$ η πιθανοφάνεια του ε.δ. x_1, \dots, x_n . Ο ΕΜΠ της θ ορίζεται με $\hat{\theta}$ ή $\hat{\theta} = \hat{\theta}(x_1, \dots, x_n)$ και ορίζεται:

$L(\hat{\theta}) = \max_{\theta \in \Theta} L(\theta)$ ή $\hat{\theta} = \text{arg max}_{\theta \in \Theta} L(\theta)$

Παρατήρηση:

(1) Το πρόβλημα εύρεσης ΕΜΠ είναι πρόβλημα μεγιστοποίησης της $L(\theta)$

$\frac{d}{d\theta} L(\theta) = 0$ (εξίσωση πιθανοφάνειας) και έστω $\hat{\theta}$ η λύση.

Το $\hat{\theta}$ είναι πιθανό ολικό μέγιστο

Αν $\left. \frac{d^2}{d\theta^2} L(\theta) \right|_{\theta=\hat{\theta}} < 0 \Rightarrow \hat{\theta}$ ολικό μέγιστο, άρα $\hat{\theta}$ ΕΜΠ.

(2) Ανά να μεγιστοποιήτε την πιθανοφάνεια $L(\theta)$, μεγιστοποιήτε τον λογάριθμό της $\log L(\theta)$

Παράδειγμα 1 (Κανονική Κατανομή)

Έστω ε.δ. x_1, \dots, x_n από $N(\mu, \sigma^2)$. Να βρεθούν οι ΕΜΠ των μ, σ^2 στις εξής περιπτώσεις:

- (i) σ^2 γνωστό, $\mu = \theta$ άγνωστο
- (ii) μ γνωστό, $\sigma^2 = \theta$ άγνωστο
- (iii) μ, σ^2 άγνωστα

Λύση

$$f(x, \mu, \sigma^2) = \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} \exp\left\{-\frac{1}{2\sigma^2}(x-\mu)^2\right\}$$

$$(i) L(\theta) = f(x_1, \dots, x_n, \mu, \sigma^2) = \prod_{i=1}^n f(x_i, \mu, \sigma^2) = \prod_{i=1}^n \frac{1}{\sigma\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{1}{2\sigma^2}(x_i-\theta)^2}$$

$$= \frac{1}{(\sqrt{2\pi}\sigma)^n} e^{-\frac{1}{2\sigma^2} \sum_{i=1}^n (x_i-\theta)^2}$$

$$\log L(\theta) = -\frac{n}{2} \log(2\pi\sigma^2) - \frac{1}{2\sigma^2} \sum_{i=1}^n (x_i-\theta)^2$$

$$\frac{d}{d\theta} \log L(\theta) = \frac{1}{\sigma^2} \sum (x_i-\theta)$$

Εξίσωση πιθανοφάνειας: $\frac{\partial}{\partial \theta} \log L(\theta) = 0 \Rightarrow \frac{1}{\sigma^2} \sum (x_i-\theta) = 0 \Rightarrow \dots \Rightarrow \theta = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i$

$$\left. \frac{d^2}{d\theta^2} \log L(\theta) \right|_{\theta = \frac{1}{n} \sum x_i} < 0$$

τοίσο ηαίση

Άρα η $L(\theta)$ μεγιστοποιείται για $\theta = \frac{1}{n} \sum x_i$.

Άρα ΕΜΠ είναι $\hat{\theta} = \hat{\mu} = \frac{1}{n} \sum x_i = \bar{x}$

Ευκρίνεια με ΑΟΕΔ.

$$(ii) L(\theta) = f(x_1, \dots, x_n, \mu, \sigma^2) = \prod_{i=1}^n f(x_i, \mu, \sigma^2) = \prod_{i=1}^n \frac{1}{\sqrt{2\pi\theta}} e^{-\frac{1}{2\theta}(x_i-\mu)^2}$$

$$= \frac{1}{(2\pi\theta)^{n/2}} e^{-\frac{1}{2\theta} \sum (x_i-\mu)^2}$$

$$\log L(\theta) = -\frac{n}{2} \log 2\pi\theta - \frac{1}{2\theta} \sum (x_i-\mu)^2$$

$$\frac{d}{d\theta} \log L(\theta) = -\frac{n}{2} + \frac{1}{2\theta^2} \sum (x_i-\mu)^2$$

Εξίσωση πιθανοφάνειας: $\frac{\partial}{\partial \theta} \log L(\theta) = 0 \Rightarrow \dots \Rightarrow \theta = \frac{1}{n} \sum (x_i-\mu)^2$.

$$\left. \frac{d^2}{d\theta^2} L(\theta) \right|_{\theta = \frac{1}{n} \sum (x_i - \mu)^2} < 0. \quad \text{Άρα } \theta = \frac{1}{n} \sum (x_i - \mu)^2 \text{ μεγιστοποιεί τον } \log L(\theta) \\ \text{άρα και τον } L(\theta).$$

Άρα ο ΕΜΠ της θ είναι $\hat{\theta} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \mu)^2$
 εφ' όσον να με τον ΑΟΕΔ.

$$(iii) L(\theta) = f(x_1, \dots, x_n, \mu, \sigma^2) = \prod_{i=1}^n f(x_i, \mu, \sigma^2) = \prod_{i=1}^n \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} e^{-\frac{1}{2\sigma^2}(x_i - \mu)^2} \\ \downarrow \theta = (\mu, \sigma^2) \\ = \frac{1}{(2\pi\sigma^2)^{n/2}} e^{-\frac{1}{2\sigma^2} \sum (x_i - \mu)^2}$$

$$\log L(\theta) = -\frac{n}{2} \log 2\pi\sigma^2 - \frac{1}{2\sigma^2} \sum_{i=1}^n (x_i - \mu)^2$$

Εξισώσεις πιθανοφάνειας:

$$\begin{cases} \frac{d}{d\mu} \log L(\theta) = 0 \\ \frac{d}{d\sigma^2} \log L(\theta) = 0 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} \frac{1}{\sigma^2} \sum_{i=1}^n (x_i - \mu) = 0 \Rightarrow \mu = \bar{x} \\ -\frac{n}{2\sigma^2} + \frac{1}{\sigma^4} \sum_{i=1}^n (x_i - \mu)^2 = 0 \Rightarrow \\ \rightarrow \sigma^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 \end{cases}$$

$\frac{d^2}{d(\mu, \sigma^2)} \log L(\theta)$ είναι αρνητικά ημισορισμένος.

Άρα ΕΜΠ της μ : $\hat{\mu} = \bar{x} \rightarrow$ εφ' όσον να με τον ΑΟΕΔ

ΕΜΠ της σ^2 : $\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 \rightarrow$ Δεν εφ' όσον να με τον ΑΟΕΔ.

ΑΟΕΔ είναι $\frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$

Παράδειγμα 2 (Χαρακτήρι Poisson)

Έστω οι x_1, \dots, x_n από Poisson (θ), $p(x, \theta) = \frac{e^{-\theta} \theta^x}{x!}$, $x=0, 1, \dots, n$, $\theta > 0$.

Να βρεθεί ΕΜΠ της θ .



$$\rightarrow L(\theta) = \prod_{i=1}^n p(x_i, \theta) = \prod_{i=1}^n \frac{e^{-\theta} \theta^{x_i}}{x_i!} = \frac{e^{-n\theta} \theta^{2x_i}}{\prod x_i!}$$

$$\log L(\theta) = -n\theta + 2x_i \log \theta - \log \prod x_i!$$

$$\frac{d}{d\theta} \log L(\theta) = -n + \frac{1}{\theta} 2x_i$$

Εξίσωση πιθανοφάνειας : $\frac{d}{d\theta} \log L(\theta) = 0 \Rightarrow \dots \Rightarrow \theta = \frac{1}{n} 2x_i$

$$\left. \frac{d^2}{d\theta^2} \log L(\theta) \right|_{\theta = \frac{1}{n} 2x_i} < 0 \quad \text{Άρα, ο } \hat{\theta} = \frac{1}{n} 2x_i = \bar{x} \text{ είναι ΕΜΤ εως } \theta.$$

Επιπλέον με τον ΑΟΕΔ.

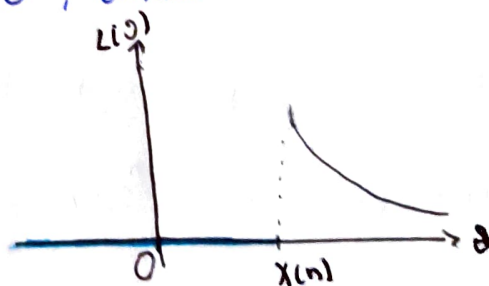
Παράδειγμα 3 (Ομοιομορφον κατανομή)

Έστω ε.δ. x_1, \dots, x_n από $U(0, \theta)$. Να βρεθεί ΕΜΤ εως θ .

Λύση Έστω οι πηχίοι πιθανοφάνειας από το θ . Σε αυτές τις περιπτώσεις ελέγχω την μονοτονία της

$$L(\theta) = \prod_{i=1}^n f(x_i, \theta) = \prod_{i=1}^n \frac{1}{\theta} I_{(0, \theta)}(x_i) = \begin{cases} \frac{1}{\theta^n}, & 0 < x_i < \theta, \forall i \\ 0, & \text{αλλιώς} \end{cases}$$

$$= \begin{cases} \frac{1}{\theta^n}, & \max_i x_i = x(n) < \theta \\ 0, & \text{αλλιώς.} \end{cases}$$



$$\frac{d}{d\theta} L(\theta) = -\frac{n\theta^{n-1}}{\theta^{2n}} = -\frac{n}{\theta^{n+1}} < 0 \Rightarrow L \text{ είναι φθίνουσα για } \theta > x(n)$$

Άρα η L παίρνει την μέγιστη τιμή της στο $\theta = x(n)$.

Άρα ο ΕΜΤ εως θ είναι $\hat{\theta} = x(n)$ και επιπλέον με τον ΑΟΕΔ.

L_n είναι το ελάχιστο

Παράδειγμα 4 (Ομοιόμορφη κατανομή)

Έστω ε.δ. X_1, \dots, X_n από $U(\theta, \theta+1)$, $\theta > 0$. Να βρεθεί ΕΜΤ εως θ .

Λύση

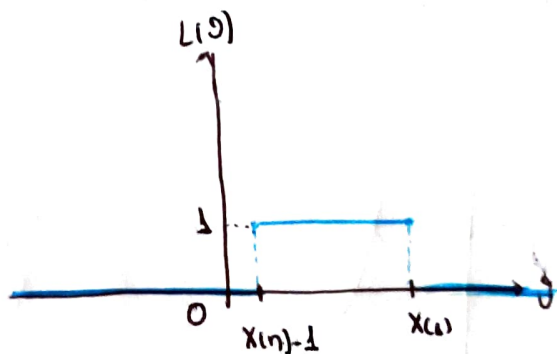
$$f(x, \theta) = \frac{1}{(\theta+1)-\theta} = 1, \quad \theta < x < \theta+1 \quad \leftarrow \text{για να επιβίωσει διακρίνοντας διαστήματα από το } \theta$$

$$L(\theta) = f(x_1, \dots, x_n; \theta) = \prod_{i=1}^n f(x_i, \theta) = \prod_{i=1}^n 1 \cdot \prod_{i=1}^n I_{(\theta, \theta+1)}(x_i) = \begin{cases} 1, & \theta < x_i < \theta+1, \forall i \\ 0, & \text{αλλιώς} \end{cases}$$

$$\left. \begin{aligned} \theta < x_i < \theta+1, \forall i=1, 2, \dots, n & : \forall i: x_i < \theta+1 \Rightarrow x_{(n)} < \theta+1 \Rightarrow \theta > x_{(n)} - 1 \\ & \forall i: \theta < x_i \Rightarrow \theta < x_{(1)} \end{aligned} \right\}$$

$$\theta < x_i < \theta+1, \forall i \Leftrightarrow x_{(n)} - 1 < \theta < x_{(1)}$$

$$\rightarrow L(\theta) = \begin{cases} 1, & x_{(n)} - 1 < \theta < x_{(1)} \\ 0, & \text{αλλιώς} \end{cases}$$



Το δε βήκιο του διαστήματος $(x_{(n)} - 1, x_{(1)})$ είναι ΕΜΤ εως θ , αφού λειτουργεί εν $L(\theta)$. Άρα έχει "άπειρος" ΕΜΤ το δε βήκιο του διαστήματος, άρα με το δε μπορούμε συνδυασμό των άκρων, δηλαδή $\hat{\theta} = \lambda(x_{(n)} - 1) + (1-\lambda)x_{(1)}, \lambda \in (0, 1)$

Παράδειγμα 5 (Ομοιόμορφη κατανομή)

Έστω ε.δ. X_1, \dots, X_n από $U(\theta_1, \theta_2)$, $\theta_1 < \theta_2$. Να βρεθεί ΕΜΤ εως θ_1, θ_2 .

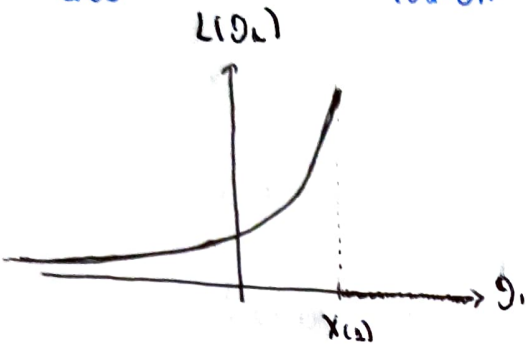
Λύση

$$f(x, \theta_1, \theta_2) = \frac{1}{\theta_2 - \theta_1}, \quad \theta_1 < x < \theta_2$$

$$L(\theta_1, \theta_2) = \prod_{i=1}^n \frac{1}{(\theta_2 - \theta_1)} I_{(\theta_1, \theta_2)}(x_i) = \begin{cases} \frac{1}{(\theta_2 - \theta_1)^n}, & \theta_1 < x_i < \theta_2, \forall i \\ 0, & \text{αλλιώς} \end{cases} = \begin{cases} \frac{1}{(\theta_2 - \theta_1)^n}, & \theta_1 < x_{(1)} \\ & \theta_2 > x_{(n)} \\ 0, & \text{αλλιώς} \end{cases}$$

Μελέτη της $L(\theta_1, \theta_2)$ ως προς θ_1 (για θ_2 αυτών θαδερò)

$$\frac{d}{d\theta_1} L(\theta_1, \theta_2) = \frac{n}{(\theta_2 - \theta_1)^{n+1}} > 0 \quad \text{Άρα η } L \text{ είναι αύξουσα ως προς } \theta_1 \text{ για } \theta_1 < \theta_2 \text{ και } 0 \text{ για } \theta_1 > \theta_2$$

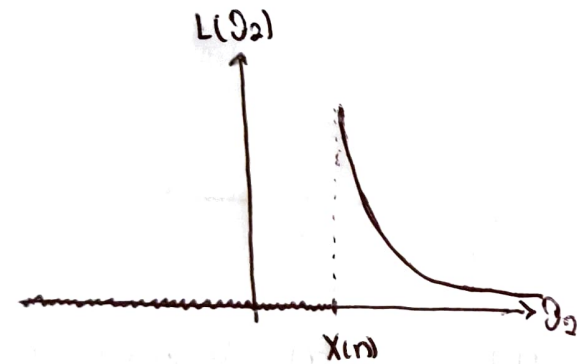


Άρα, η L μεγιστοποιείται για $\theta_1 = \theta_2$.

Άρα ΕΜΠ της θ_1 ο $\hat{\theta}_1 = \theta_2$

Ανάλυση για ως θ_2

$$\frac{d}{d\theta_2} L(\theta_1, \theta_2) = \frac{-n}{(\theta_2 - \theta_1)^{n+1}} < 0 \quad \text{Άρα, η } L \text{ είναι φθίνουσα ως προς } \theta_2 \text{ για } \theta_2 > \theta_1 \text{ και } 0 \text{ για } \theta_2 < \theta_1.$$



Άρα, η L μεγιστοποιείται ως προς θ_2 για $\theta_2 = \theta_1$. Άρα ΕΜΠ της θ_2 ο $\hat{\theta}_2 = \theta_1$.

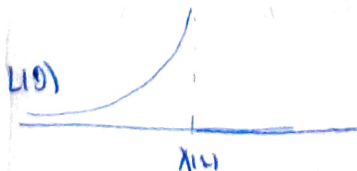
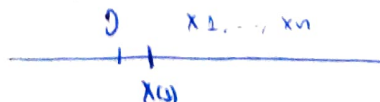
Άσκηση: Έστω τ.δ. X_1, X_2, \dots, X_n από κατανομή Laplace με $\theta_1 = \theta_2 = \theta$.

$$f(x, \theta) = e^{-(x-\theta)}, \quad x \geq \theta. \quad \text{Να βρεθεί ΕΜΠ της } \theta.$$

(Το π.δ.δ. στατιστικής) της κατανομής εξαρτάται από το θ . Άρα θα πάω με την βοήθειά μου

→ είναι γενίκεση της κατανομής

Απάντηση $\hat{\theta} = X_{(1)}$



(Να εννοώ αναλυτικά)

Παράδειγμα 6 (Γάμμα κατανομή)

Έστω ε.δ. x_1, \dots, x_n από $G(a, \beta)$, $f(x, a, \beta) = \frac{1}{\beta^a \Gamma(a)} x^{a-1} e^{-x/\beta}$, $x > 0$, $a, \beta > 0$

Να βρεθεί ΕΜΠ των a, β .

Λύση

$$L(a, \beta) = \prod_{i=1}^n f(x_i, a, \beta) = \frac{1}{\beta^{na} \Gamma^n(a)} (\prod x_i)^{a-1} e^{-\sum x_i / \beta}$$

$$\log L(a, \beta) = -na \log \beta - n \log \Gamma(a) + (a-1) \sum \log x_i - \frac{1}{\beta} \sum x_i$$

Εξισώσεις Πιθανοφάνειας: $\begin{cases} \frac{d}{da} \log L(a, \beta) = 0 \\ \frac{d}{d\beta} \log L(a, \beta) = 0 \end{cases} \Rightarrow \dots \Rightarrow \begin{cases} -n \frac{\Gamma'(a)}{\Gamma(a)} - n \log \beta + \sum_{i=1}^n \log x_i = 0 & (1) \\ a\beta = \bar{x} & (2) \end{cases}$

Από την (2): $\beta = \frac{\bar{x}}{a}$. Από την (1): $-n \frac{\Gamma'(a)}{\Gamma(a)} - n \log \frac{\bar{x}}{a} + \sum_{i=1}^n \log x_i = 0$

Δεν λύνεται σε κλειστή μορφή ως προς a .

Λύνω ως προς a με αριθμητικές μεθόδους και βρίσκω τον ΕΜΠ \hat{a} .

Τότε, ο ΕΜΠ της β είναι $\hat{\beta} = \frac{\bar{x}}{\hat{a}}$

• Ασυμπτωτική κανονικότητα του ΕΜΠ $\hat{\theta}$: $\sqrt{n}(\hat{\theta} - \theta) \xrightarrow{n \rightarrow \infty} N(0, [I_2(\theta)]^{-1})$

Μέθοδος Ροπών

Στηρίζεται στην αναλογία (έξισή) μεταξύ πληθυσμιακών και δειγματικών ροπών

Έστω ε.δ. x_1, \dots, x_n από $f(x, \theta)$, $\theta \in \Theta \subseteq \mathbb{R}^r$.

Πληθυσμιακές Ροπές: $\mu_k = E(X^k) = \int x^k f(x, \theta) dx = \mu_k(\theta_1, \theta_2, \dots, \theta_r)$, $k=1, 2, \dots$

Δειγματικές Ροπές: $m_k = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^k$, $k=1, 2, \dots$

↓
 Ιδιότητες (Μαθηματικά):

(i) m_k ακεραίοι αριθμοί αν μ_k (για $i=1, \dots, r$)

[Από να δείξω $E(m_k) = \mu_k, k=1, 2, \dots, r$]

Διασπαστικό: $m_k \approx \mu_k$

(ii) $m_k \xrightarrow[n \rightarrow \infty]{P} \mu_k, n=1, 2, \dots$ (αρχή των μεγάλων αριθμών)

Από τα (i) και (ii) έχουμε:

$$\mu_1 = \mu_1(\theta_1, \dots, \theta_r) = m_1 = \frac{1}{n} \sum x_i$$

$$\mu_2 = \mu_2(\theta_1, \theta_2, \dots, \theta_r) = m_2 = \frac{1}{n} \sum x_i^2$$

⋮

$$\mu_r = \mu_r(\theta_1, \theta_2, \dots, \theta_r) = m_r = \frac{1}{n} \sum x_i^r$$

⇒ οι αναμενόμενες ποσότητες των $\theta_1, \theta_2, \dots, \theta_r$ αφορούν $\mu_1, \mu_2, \dots, \mu_r$ και προκύπτουν από εν συνόλη του δείγματος:

$$\mu_1(\theta_1, \dots, \theta_r) = m_1 = \frac{1}{n} \sum x_i$$

$$\mu_2(\theta_1, \dots, \theta_r) = m_2 = \frac{1}{n} \sum x_i^2$$

⋮

$$\mu_r(\theta_1, \dots, \theta_r) = m_r = \frac{1}{n} \sum x_i^r$$

Παράδειγμα (Κανονική κατανομή)

Έστω x_1, x_2, \dots, x_n από $N(\mu, \sigma^2)$. Να βρεθούν οι αναμενόμενες ποσότητες των μ, σ^2 .

Λύση

Έχουμε δύο παρατηρήσεις, → άρα έχουμε δύο εξισώσεις $\left\{ \begin{array}{l} \mu_1 = m_1 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i \\ \mu_2 = m_2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 \end{array} \right. \quad (*)$

Είναι $\mu_1 \stackrel{OP}{=} E(x) = \mu$

$\mu_2 \stackrel{OP}{=} E(x^2) = \text{Var}(x) + (E(x))^2 = \sigma^2 + \mu^2$

$\left\{ \begin{array}{l} \mu_1 \\ \mu_2 \end{array} \right. \Rightarrow \mu = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i = \bar{x}$. Άρα ο αναμενόμενος ποσότητα του μ είναι $\hat{\mu} = \bar{x}$.

(Από την δεύτερη εξίσωση θα έχω: $\sigma^2 + \mu^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 \Rightarrow \sigma^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \mu^2$

Άρα, ο αναμενόμενος ποσότητα του σ^2 είναι $\hat{\sigma}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{x}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{x}^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2$. Διηγούμενος με ως ΕΜΤ.

Παράδειγμα (Γαββία μακανθίν)

Έστω ε.δ. x_1, x_2, \dots, x_n από Gamma (a, b) . Να βρεθούν οι εκτιμητές ποσών
αυτ a, b

Λύση

Έχω δύο παρατηρήσεις \rightarrow άρα και δύο εξισώσεις

$$k_1 = m_1 \Rightarrow E(x) = \frac{1}{n} \sum x_i = \bar{x} \Rightarrow ab = \bar{x}$$

$$k_2 = m_2 \Rightarrow E(x^2) = \frac{1}{n} \sum x_i^2 \rightarrow \text{Var}x + (E(x))^2 = \frac{1}{n} \sum x_i^2 \Rightarrow ab^2 + a^2b^2 = \frac{1}{n} \sum x_i^2.$$

Επιπλέον οι εκτιμητές ποσών \tilde{a}, \tilde{b} προκύπτουν από την λύση του συστήματος:

$$\left\{ \begin{array}{l} ab = \bar{x} \\ ab^2 + a^2b^2 = \frac{1}{n} \sum x_i^2 \end{array} \right\} \rightarrow \tilde{a} = \frac{\bar{x}^2}{\frac{1}{n} \sum (x_i - \bar{x})^2}, \quad \tilde{b} = \frac{\frac{1}{n} \sum (x_i - \bar{x})^2}{\bar{x}}$$