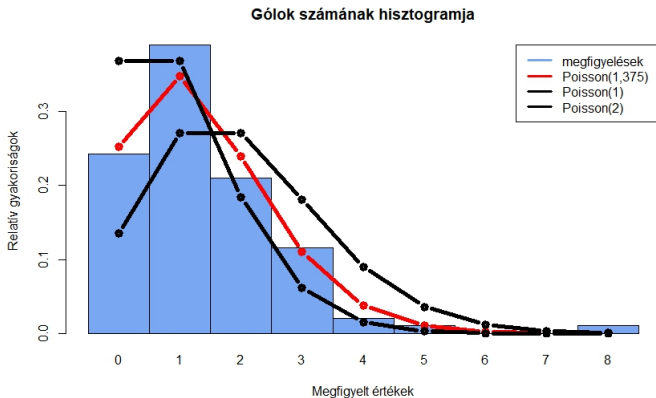
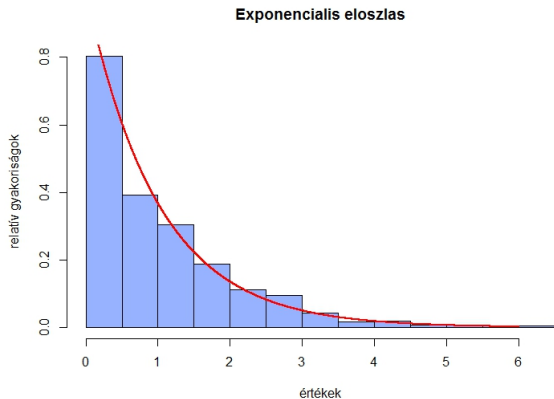


# Poisson-eloszlás paraméterének becslése (3. előadás)



A gólok számának hisztogramja  $n = 95$  mérkőzésen, és különböző paraméterű Poisson-eloszlások ( $\mathbb{P}_\lambda(X = k) = \lambda^k / k! \cdot e^{-\lambda}$ ).  $\lambda = 1,375$  a gólok átlagos száma.

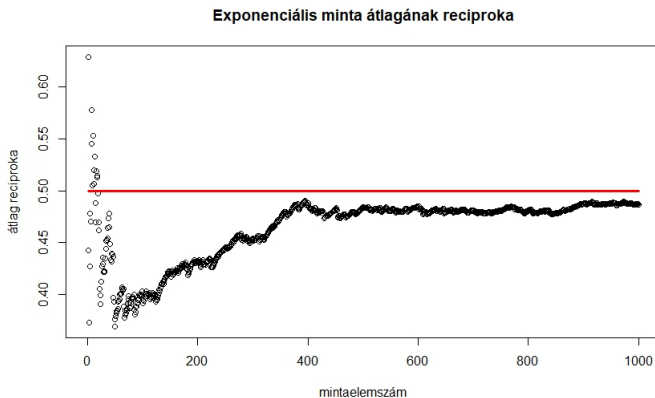
# Az exponenciális eloszlású minta hisztogramja



Exponenciális eloszlású minta hisztogramja és sűrűségfüggvénye:

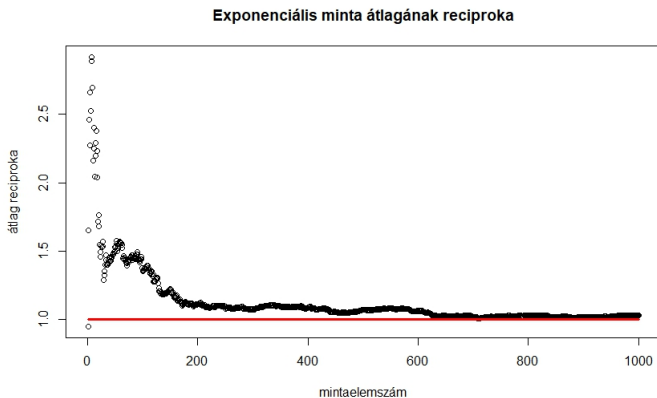
$$f(x) = \lambda \exp(-\lambda x) \mathbb{I}(x > 0); \quad \mathbb{E}(X) = D(X) = \frac{1}{\lambda}.$$

# Exponenciális eloszlás



$\lambda = 0,5$  paraméterű exponenciális eloszlást generálva a mintaátlag reciproka 0,5-höz tart, azaz **konzisztens** becslés, hiszen ez minden  $\lambda$ -ra teljesül.

# Exponenciális eloszlás



$\lambda = 1$  paraméterű exponenciális eloszlást generálva a mintaátlag reciproka 1-hez tart, azaz **konzisztens** becslés, hiszen ez minden  $\lambda$ -ra teljesül.

# Minta és statisztika

## Definíció (Minta)

Legyen  $(\Omega, \mathcal{A}, \mathcal{P})$  statisztikai mező. Egy

$$\underline{X} = (X_1, X_2, \dots, X_n) : \Omega \rightarrow B \subseteq \mathbb{R}^n$$

valószínűségi vektorváltozót ( $n$  elemű) **mintának** nevezünk. Itt  $B$  a mintatér,  $n$  a minta elemszáma vagy nagysága. A minta független, ha az  $X_1, X_2, \dots, X_n$  valószínűségi változók függetlenek.

# Minta és statisztika

## Definíció (Minta)

Legyen  $(\Omega, \mathcal{A}, \mathcal{P})$  statisztikai mező. Egy

$$\underline{X} = (X_1, X_2, \dots, X_n) : \Omega \rightarrow B \subseteq \mathbb{R}^n$$

valószínűségi vektorváltozót ( $n$  elemű) **mintának** nevezünk. Itt  $B$  a mintatér,  $n$  a minta elemszáma vagy nagysága. A minta független, ha az  $X_1, X_2, \dots, X_n$  valószínűségi változók függetlenek.

## Definíció (Statisztika)

Legyen  $T : B \rightarrow \mathbb{R}^k$  függvény. Ekkor a  $T(X_1, X_2, \dots, X_n)$  valószínűségi változót statisztikának nevezzük.

Például:  $T(X_1, \dots, X_n) = \bar{X}$  a mintaátlag, vagy  $T(X_1, \dots, X_n) = s_n^*$  a korrigált tapasztalati szórásnégyzet.

# Statisztikai mező

## Definíció

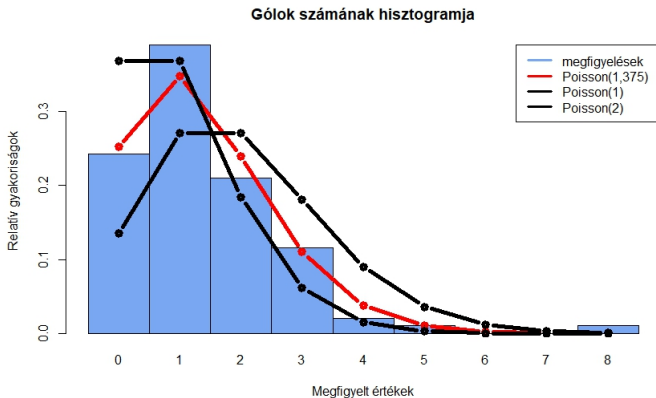
Az  $(\Omega, \mathcal{A}, \mathcal{P})$  hármast **statisztikai mezőnek** nevezzük, ha minden  $\mathbb{P} \in \mathcal{P}$ -re  $(\Omega, \mathcal{A}, \mathbb{P})$  Kolmogorov-féle valószínűségi mező.

Paraméteres statisztikai mező:  $\mathcal{P} = \{\mathbb{P}_\vartheta : \vartheta \in \Theta\}$ . Ekkor  $\vartheta$  az ismeretlen paraméter, mely egy  $\Theta \subseteq \mathbb{R}^q$  ismert halmaz eleme.

Például:  $\mathcal{P}$  lehet például

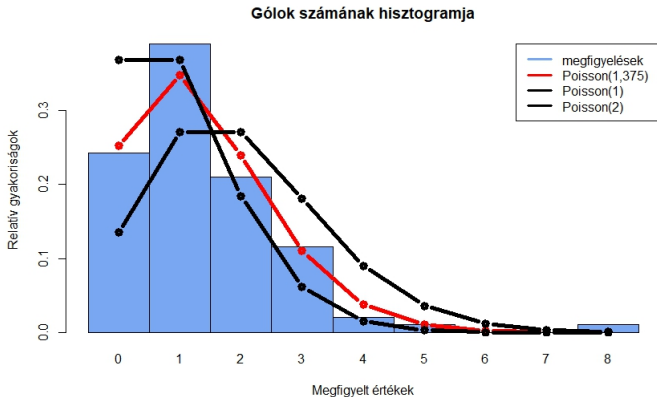
- a  $\lambda$  paraméterű Poisson-eloszlások halmaza;
- a normális eloszlások halmaza (ekkor  $\vartheta = (m, \sigma)$  az ismeretlen paraméter);
- az  $[a, b]$  intervallumon egyenletes eloszlások halmaza (ekkor  $\vartheta = (a, b)$  az ismeretlen paraméter).

# Poisson-eloszlás paraméterének becslése



A gólok számának hisztogramja  $n = 95$  mérkőzésen, és különböző paraméterű Poisson-eloszlások. Ekkor

# Poisson-eloszlás paraméterének becslése



A gólok számának histogramja  $n = 95$  mérkőzésen, és különböző paraméterű Poisson-eloszlások. Ekkor

$$\mathbb{E}(\bar{X}) = \mathbb{E}(X_1) = \lambda \quad \text{minden } \lambda\text{-ra.}$$

Ha az átlaggal becsljük a paramétert, akkor a becslésünk várható értéke  $\lambda$ .

## Egyenletes eloszlás paraméterének becslése

Legyen  $X_1, X_2, \dots, X_n$  független azonos eloszlású minta az  $\{1, 2, \dots, N\}$  halma-  
zon egyenletes eloszlásból, ahol  $N$  ismeretlen paraméter [https://en.wikipedia.  
org/wiki/German\\_tank\\_problem](https://en.wikipedia.org/wiki/German_tank_problem).

Például: 52, 38, 14, 69, 44, 28.

Átlag: 40, 83

Hogyan becsülnénk ez alapján  $N$ -t?

## Egyenletes eloszlás paraméterének becslése

Legyen  $X_1, X_2, \dots, X_n$  független azonos eloszlású minta az  $\{1, 2, \dots, N\}$  halma-  
zon egyenletes eloszlásból, ahol  $N$  ismeretlen paraméter [https://en.wikipedia.  
org/wiki/German\\_tank\\_problem](https://en.wikipedia.org/wiki/German_tank_problem).

Például: 52, 38, 14, 69, 44, 28.

Átlag: 40, 83

Hogyan becsülnénk ez alapján  $N$ -t?

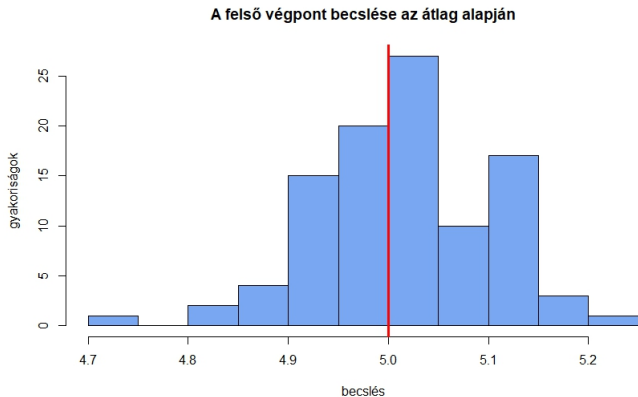
Folytonos változat: legyen  $X_1, X_2, \dots, X_n$  független azonos eloszlású minta a  $[0, \vartheta]$   
intervallumon egyenletes eloszlásból, ahol  $\vartheta > 0$  ismeretlen paraméter.

Minta:  $X_1, X_2, \dots, X_5$ , például 4, 3;      5, 6;      3, 2;      1, 8;      2, 2

Átlag:  $\bar{X} = 3,42$

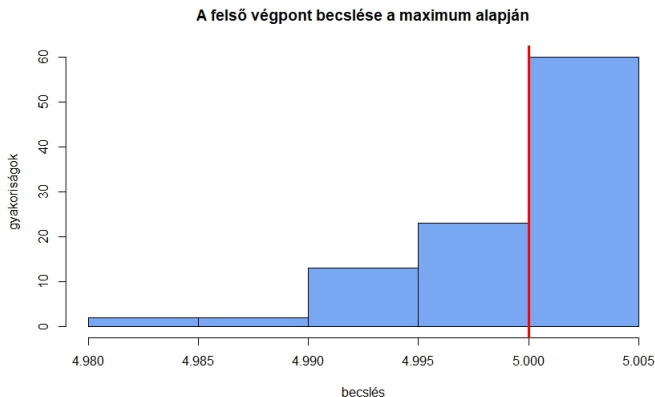
Hogyan becsülnénk ez alapján  $\vartheta$ -t?

# Egyenletes eloszlás paraméterének becslése



A  $[0, \vartheta]$  intervallumon egyenletes eloszlás paraméterének becslése  $T(X) = 2\bar{X}$ -szel,  $n = 1000$  elemű mintából. Az igazi paraméter  $\vartheta = 5$ . Száz ismétlésből a becslések átlaga: **5,015**, korigált tapasztalati szórása: **0,086**.

# Egyenletes eloszlás paraméterének becslése



A  $[0, \vartheta]$  intervallumon egyenletes eloszlás paraméterének becslése a maximum alapján  $T(X) = \frac{n+1}{n} \max(X_1, \dots, X_n)$ -nel,  $n = 1000$  elemű mintából. Az igazi paraméter  $\vartheta = 5$ . Száz ismétlésből a becslések átlaga: **4,9999**, korrigált tapasztalati szórása: **0,0049** < **0,086**.

## Egyenletes eloszlás paraméterének becslése

$X_1, X_2, \dots, X_n$  független azonos eloszlású, a  $[0, \vartheta]$  intervallumon egyenletes eloszlású valószínűségi változók. Itt  $\vartheta > 0$  ismeretlen paraméter. Tekintsük a  $\vartheta$  két különböző becslését:

$$T_1(X_1, \dots, X_n) = 2\bar{X}; \quad \mathbb{E}_{\vartheta}(T_1) = 2 \cdot \frac{\vartheta}{2} = \vartheta; \quad D_{\vartheta}(T_1) = \frac{\vartheta}{\sqrt{3n}}.$$

Másrészt, felhasználva, hogy  $X_n^* = \max(X_1, \dots, X_n)$  sűrűségfüggvénye:  $f_{\vartheta}(t) = (nt^{n-1}/\vartheta^n)\mathbb{I}(0 \leq t \leq \vartheta)$ , egy másik becslést is találhatunk:

$$T_2(X_1, \dots, X_n) = \frac{n+1}{n} \cdot X_n^*; \quad \mathbb{E}_{\vartheta}(T_2) = \frac{n+1}{n} \cdot \frac{n\vartheta}{n+1} = \vartheta.$$

$$D_{\vartheta}(T_2) = \sqrt{\frac{n \cdot \vartheta^2}{(n+2)(n+1)^2}} \leq \frac{\vartheta}{n+1} < \frac{\vartheta}{\sqrt{3n}}.$$

## Egyenletes eloszlás paraméterének becslése

$X_1, X_2, \dots, X_n$  független azonos eloszlású, a  $[0, \vartheta]$  intervallumon egyenletes eloszlású valószínűségi változók. Itt  $\vartheta > 0$  ismeretlen paraméter. Tekintsük a  $\vartheta$  két különböző becslését:

$$T_1(X_1, \dots, X_n) = 2\bar{X}; \quad \mathbb{E}_{\vartheta}(T_1) = 2 \cdot \frac{\vartheta}{2} = \vartheta; \quad D_{\vartheta}(T_1) = \frac{\vartheta}{\sqrt{3n}}.$$

Másrészt, felhasználva, hogy  $X_n^* = \max(X_1, \dots, X_n)$  sűrűségfüggvénye:  $f_{\vartheta}(t) = (nt^{n-1}/\vartheta^n)\mathbb{I}(0 \leq t \leq \vartheta)$ , egy másik becslést is találhatunk:

$$T_2(X_1, \dots, X_n) = \frac{n+1}{n} \cdot X_n^*; \quad \mathbb{E}_{\vartheta}(T_2) = \frac{n+1}{n} \cdot \frac{n\vartheta}{n+1} = \vartheta.$$

$$D_{\vartheta}(T_2) = \sqrt{\frac{n \cdot \vartheta^2}{(n+2)(n+1)^2}} \leq \frac{\vartheta}{n+1} < \frac{\vartheta}{\sqrt{3n}}.$$

Mindkét becslés **torzítatlan**  $\vartheta$ -ra, és a második **hatásosabb**.

# Becslések és tulajdonságaik

- $(\Omega, \mathcal{A}, \mathcal{P})$  statisztikai mező;
- $\mathcal{P} = \{\mathbb{P}_\vartheta : \vartheta \in \Theta\}$  valamely  $\Theta$  halmazzal ( $\Theta$  a paraméterter);
- $g : \Theta \rightarrow \mathbb{R}$  függvény.
- Cél: olyan  $T$  statisztika keresése, amire a  $T(X)$  valószínűségi változó és a  $g(\vartheta)$  érték valamilyen értelemben közel esnek egymáshoz.

# Becslések és tulajdonságaik

- $(\Omega, \mathcal{A}, \mathcal{P})$  statisztikai mező;
- $\mathcal{P} = \{\mathbb{P}_\vartheta : \vartheta \in \Theta\}$  valamely  $\Theta$  halmazzal ( $\Theta$  a paraméterter);
- $g : \Theta \rightarrow \mathbb{R}$  függvény.
- Cél: olyan  $T$  statisztika keresése, amire a  $T(X)$  valószínűségi változó és a  $g(\vartheta)$  érték valamilyen értelemben közel esnek egymáshoz.

## Definíció (Torzítatlanság)

A  $T$  statisztika torzítatlan becslés  $\psi$ -re, ha minden  $\vartheta \in \Theta$ -ra

$$\mathbb{E}_\vartheta(T(X_1, \dots, X_n)) = g(\vartheta).$$

A  $T$  statisztika torzítása a  $b_T(\vartheta) = \mathbb{E}_\vartheta(T(X_1, \dots, X_n)) - g(\vartheta)$  függvény.

**Példa.**  $X_1, X_2, \dots, X_n$  független minta a  $[0, \vartheta]$  intervallumon egyenletes eloszlásból.

# Becslések és tulajdonságaik

- $(\Omega, \mathcal{A}, \mathcal{P})$  statisztikai mező;
- $\mathcal{P} = \{\mathbb{P}_\vartheta : \vartheta \in \Theta\}$  valamely  $\Theta$  halmazzal ( $\Theta$  a paraméterter);
- $g : \Theta \rightarrow \mathbb{R}$  függvény.
- Cél: olyan  $T$  statisztika keresése, amire a  $T(X)$  valószínűségi változó és a  $g(\vartheta)$  érték valamilyen értelemben közel esnek egymáshoz.

## Definíció (Torzítatlanság)

A  $T$  statisztika torzítatlan becslés  $\psi$ -re, ha minden  $\vartheta \in \Theta$ -ra

$$\mathbb{E}_\vartheta(T(X_1, \dots, X_n)) = g(\vartheta).$$

A  $T$  statisztika torzítása a  $b_T(\vartheta) = \mathbb{E}_\vartheta(T(X_1, \dots, X_n)) - g(\vartheta)$  függvény.

**Példa.**  $X_1, X_2, \dots, X_n$  független minta a  $[0, \vartheta]$  intervallumon egyenletes eloszlásból. Ekkor  $2\bar{X}$  torzítatlan becslés  $g(\vartheta) = \vartheta$ -ra:  $\mathbb{E}(2\bar{X}) = \vartheta$ .

# Torzítatlan becslések

## Állítás (A várható érték torzítatlan becslése)

Legyen  $X_1, \dots, X_n$  független azonos eloszlású véges várható értékű minta. Ekkor

$$\mathbb{E}_\vartheta(\bar{X}) = \mathbb{E}_\vartheta(X_1) \quad \text{minden } \vartheta \in \Theta\text{-ra,}$$

vagyis a **mintaátlag** torzítatlan becslés  $\psi$ -re.

## Állítás (A szórásnégyzet torzítatlan becslése)

$X_1, \dots, X_n$  független azonos eloszlású véges szórású minta. Ekkor Ekkor

$$\mathbb{E}_\vartheta(s_n^{*2}) = D_\vartheta^2(X_1) \quad \text{minden } \vartheta \in \Theta\text{-ra,}$$

vagyis a **korrigált tapasztalati szórásnégyzet** torzítatlan becslés a szórásnégyzet-re.

# Az átlag várható értéke

## Állítás

Legyen  $X_1, \dots, X_n$  független azonos eloszlású minta, és  $m = \mathbb{E}(X_i) < \infty$ . Ekkor

$$\mathbb{E}(\bar{X}) = m.$$

# Az átlag várható értéke

## Állítás

Legyen  $X_1, \dots, X_n$  független azonos eloszlású minta, és  $m = \mathbb{E}(X_i) < \infty$ . Ekkor

$$\mathbb{E}(\bar{X}) = m.$$

## Bizonyítás.

$$\mathbb{E}(\bar{X}) = \mathbb{E}\left(\frac{X_1 + \dots + X_n}{n}\right) = \frac{1}{n}\mathbb{E}(X_1 + \dots + X_n) = \frac{1}{n} \cdot nm = m.$$

Felhasználtuk a várható érték linearitását, és hogy csak eloszlástól függ:

- $\mathbb{E}(cX) = c\mathbb{E}(X)$ , ha  $c \in \mathbb{R}$ ;
- $\mathbb{E}(Y + Z) = \mathbb{E}(Y) + \mathbb{E}(Z)$ ;
- ha  $Y$  és  $Z$  eloszlása megegyezik, akkor  $\mathbb{E}(Y) = \mathbb{E}(Z)$

Tehát a **mintaátlag** torzítatlan becslés a várható értékre.

Speciálisan: a **relatív gyakoriság** torzítatlan becslés egy esemény valószínűségére.

## Az átlag szórása

### Állítás

Legyen  $X_1, \dots, X_n$  független azonos eloszlású minta, és  $\mathbb{E}(X_i^4) < \infty$ . Ekkor

$$D(\bar{X}) = \frac{D(X_1)}{\sqrt{n}}.$$

# Az átlag szórása

## Állítás

Legyen  $X_1, \dots, X_n$  független azonos eloszlású minta, és  $\mathbb{E}(X_i^4) < \infty$ . Ekkor

$$D(\bar{X}) = \frac{D(X_1)}{\sqrt{n}}.$$

## Bizonyítás.

$$D(\bar{X}) = D\left(\frac{X_1 + \dots + X_n}{n}\right) = \frac{D(X_1 + \dots + X_n)}{n} = \frac{\sqrt{nD^2(X_1)}}{n} = \frac{D(X_1)}{\sqrt{n}}.$$

Felhasználtuk a szórás alábbi tulajdonságait:

- $D(cX) = |c|D(X)$ , ha  $c \in \mathbb{R}$  valós szám;
- $D(Y + Z) = \sqrt{D^2(Y) + D^2(Z)}$ , ha  $Y$  és  $Z$  függetlenek;
- ha  $Y$  és  $Z$  eloszlása megegyezik, akkor  $D(Y) = D(Z)$

# Tapasztalati szórásnégyzet

Állítás (A tapasztalati szórásnégyzet másik alakja)

$$s_n^2 = \frac{1}{n} \left[ \sum_{k=1}^n X_k^2 \right] - \bar{X}^2.$$

**Bizonyítás.** Átrendezéssel kapjuk, hogy

$$\begin{aligned} \sum_{k=1}^n (X_k - \bar{X})^2 &= \sum_{k=1}^n [X_k^2 - 2X_k \cdot \bar{X} + \bar{X}^2] = \sum_{k=1}^n X_k^2 - 2n\bar{X} \cdot \bar{X} + n \cdot \bar{X}^2 = \\ &= \sum_{k=1}^n X_k^2 - n \cdot \bar{X}^2. \end{aligned}$$

Ebből adódik, hogy

$$s_n^2 = \frac{1}{n} \left[ \sum_{k=1}^n (X_k - \bar{X})^2 \right] = \frac{1}{n} \left[ \sum_{k=1}^n X_k^2 \right] - \bar{X}^2,$$

a tapasztalati szórásnégyzet definíciója alapján.

## Korrigált tapasztalati szórásnégyzet

$$s_n^{*2} = \frac{n}{n-1} s_n^2 = \frac{n}{n-1} \left[ \frac{1}{n} \left[ \sum_{k=1}^n X_k^2 \right] - \bar{X}^2 \right] = \frac{1}{n-1} \left[ \sum_{k=1}^n X_k^2 \right] - \frac{n}{n-1} \bar{X}^2.$$

Az első tag várható értéke a szórásnégyzet definíciója alapján:

$$\mathbb{E}_\vartheta \left( \sum_{k=1}^n X_k^2 \right) = \sum_{k=1}^n \mathbb{E}_\vartheta (X_k^2) = n \cdot \mathbb{E}_\vartheta (X_1^2) = n \cdot [D_\vartheta^2(X_1) + \mathbb{E}_\vartheta (X_1)^2].$$

A második tag várható értéke az átlag szórásnégyzete alapján:

$$\mathbb{E}_\vartheta (\bar{X}^2) = D_\vartheta^2(\bar{X}) + \mathbb{E}_\vartheta (\bar{X})^2 = \frac{1}{n} D_\vartheta^2(X_1) + \mathbb{E}_\vartheta (X_1)^2.$$

Vagyis valóban  $s_n^{*2}$  torzítatlan becslés a szórásnégyzetre:

$$\mathbb{E}_\vartheta (s_n^{*2}) = \frac{n}{n-1} [D_\vartheta^2(X_1) + \mathbb{E}_\vartheta (X_1)^2] - \frac{n}{n-1} \left[ \frac{1}{n} D_\vartheta^2(X_1) + \mathbb{E}_\vartheta (X_1)^2 \right] = D_\vartheta^2(X_1).$$

# Becslések összehasonlítása

## Definíció (Hatásosság)

Legyenek  $T_1, T_2$  **torzítatlan** becslései a paraméter  $\psi(\vartheta)$  függvényének.  $T_1$  **hatásosabb**  $T_2$ -nél, ha

$$D_{\vartheta}^2(T_1) \leq D_{\vartheta}^2(T_2)$$

teljesül minden  $\vartheta \in \Theta$ -ra.

A  $T_1$  becslés **hatásos**  $\psi(\vartheta)$ -ra, ha  $\psi(\vartheta)$  minden torzítatlan becslésénél hatásosabb (és ő maga is torzítatlan).

# Becslések összehasonlítása

## Definíció (Hatásosság)

Legyenek  $T_1, T_2$  **torzítatlan** becslései a paraméter  $\psi(\vartheta)$  függvényének.  $T_1$  **hatásosabb**  $T_2$ -nél, ha

$$D_{\vartheta}^2(T_1) \leq D_{\vartheta}^2(T_2)$$

teljesül minden  $\vartheta \in \Theta$ -ra.

A  $T_1$  becslés **hatásos**  $\psi(\vartheta)$ -ra, ha  $\psi(\vartheta)$  minden torzítatlan becslésénél hatásosabb (és ő maga is torzítatlan).

- Nem mindig létezik hatásos becslés, és lehetséges, hogy  $T_1$  és  $T_2$  közül egyik sem hatásosabb a másiknál.
- A várható értékre nézve a mintaátlag hatásosabb minden  $\sum_{j=1}^n c_j X_j$  alakú becslésnél (ahol  $\sum_{j=1}^n c_j = 1$ ).

# Becslések összehasonlítása

## Definíció (Hatásosság)

Legyenek  $T_1, T_2$  **torzítatlan** becslései a paraméter  $\psi(\vartheta)$  függvényének.  $T_1$  **hatásosabb**  $T_2$ -nél, ha

$$D_{\vartheta}^2(T_1) \leq D_{\vartheta}^2(T_2)$$

teljesül minden  $\vartheta \in \Theta$ -ra.

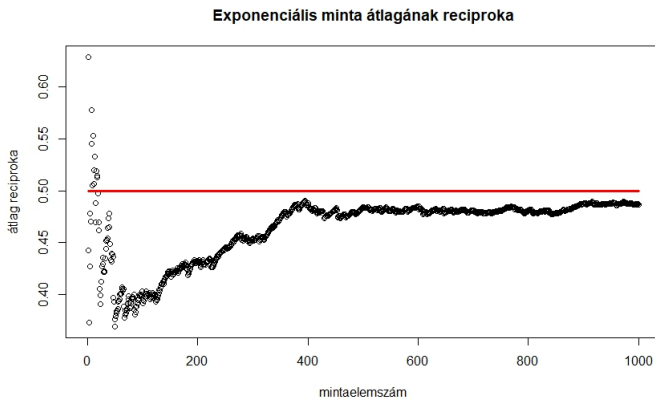
A  $T_1$  becslés **hatásos**  $\psi(\vartheta)$ -ra, ha  $\psi(\vartheta)$  minden torzítatlan becslésénél hatásosabb (és ő maga is torzítatlan).

- Nem mindig létezik hatásos becslés, és lehetséges, hogy  $T_1$  és  $T_2$  közül egyik sem hatásosabb a másiknál.
- A várható értékre nézve a mintaátlag hatásosabb minden  $\sum_{j=1}^n c_j X_j$  alakú becslésnél (ahol  $\sum_{j=1}^n c_j = 1$ ).
- **Bizonyos feladatokban lehet a mintaátlagnál hatásosabb becslés a várható értékre:** A  $[0, b]$  intervallumon egyenletes eloszlás esetén  $b$ -re  $\frac{n+1}{n} \max(X_1, \dots, X_n)$  hatásosabb a mintaátlag kétszeresénél.

## Házi feladat március 21., kedd, 10:15-ig

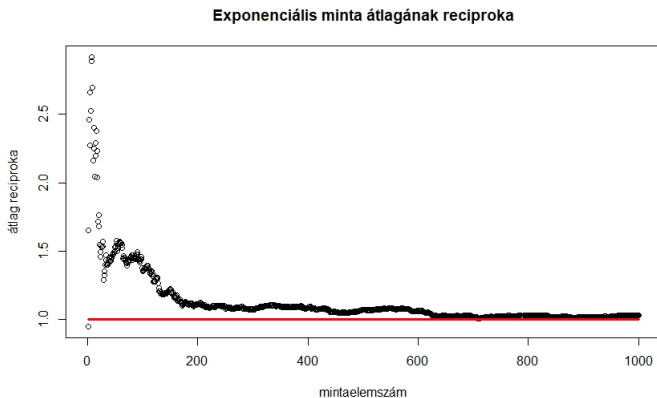
Legyen  $X_1, \dots, X_n$  az  $N(m, 4)$ ,  $Y_1, \dots, Y_n$  pedig az  $N(m, 25)$  normális eloszlásból származó független minta. (A második paraméter a szórásnégyzetet jelöli.) Adjuk meg a legkisebb szórású  $a\bar{X} + b\bar{Y}$  alakú torzítatlan becslést  $m$ -re

# Exponenciális eloszlás



$\lambda = 0,5$  paraméterű exponenciális eloszlást generálva a mintaátlag reciproka  $0,5$ -höz tart, azaz **konzisztens** becslés, hiszen ez minden  $\lambda$ -ra teljesül.

# Exponenciális eloszlás



$\lambda = 1$  paraméterű exponenciális eloszlást generálva a mintaátlag reciproka 1-hez tart, azaz **konzisztens** becslés, hiszen ez minden  $\lambda$ -ra teljesül.

# Konzisztencia

## Definíció

A  $T_n = T_n(X_1, \dots, X_n)$  **konzisztens** becsléssorozat  $\psi(\vartheta)$ -ra, ha minden  $\vartheta \in \Theta$ -ra

$$(T_n(X_1, \dots, X_n)) \rightarrow \psi(\vartheta)$$

$n \rightarrow \infty$  esetén sztochasztikusan, azaz minden  $\vartheta \in \Theta$  és  $\varepsilon > 0$ -ra teljesül, hogy

$$\mathbb{P}_\vartheta(|T_n - \psi(\vartheta)| > \varepsilon) \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty).$$

# Konzisztencia

## Definíció

A  $T_n = T_n(X_1, \dots, X_n)$  **konzisztens** becsléssorozat  $\psi(\vartheta)$ -ra, ha minden  $\vartheta \in \Theta$ -ra

$$(T_n(X_1, \dots, X_n)) \rightarrow \psi(\vartheta)$$

$n \rightarrow \infty$  esetén sztochasztikusan, azaz minden  $\vartheta \in \Theta$  és  $\varepsilon > 0$ -ra teljesül, hogy

$$\mathbb{P}_\vartheta(|T_n - \psi(\vartheta)| > \varepsilon) \rightarrow 0 \quad (n \rightarrow \infty).$$

Elégséges feltétel:

$$\mathbb{E}_\vartheta(T_n(X)) \rightarrow \vartheta \quad \text{és} \quad D_\vartheta(T_n(X)) \rightarrow 0$$

minden  $\vartheta \in \Theta$ -ra.

## Példák torzítatlan, konzisztens becslésekre

$X_1, X_2, \dots$  független azonos eloszlású minta. Ekkor

$$T_n = \frac{X_1 + X_2 + \dots + X_n}{n} \rightarrow \mathbb{E}_\vartheta(X_1)$$

teljesül  $n \rightarrow \infty$  esetén sztochasztikusan a nagy számok gyenge törvénye szerint, vagyis az **átlag** konzisztens becslés a **várható értékre**.

Speciális eset: a **relatív gyakoriság** konzisztens becslés a **valószínűségre**.

## Példák torzítatlan, konzisztens becslésekre

$X_1, X_2, \dots$  független azonos eloszlású minta. Ekkor

$$T_n = \frac{X_1 + X_2 + \dots + X_n}{n} \rightarrow \mathbb{E}_\vartheta(X_1)$$

teljesül  $n \rightarrow \infty$  esetén sztochasztikusan a nagy számok gyenge törvénye szerint, vagyis az **átlag** konzisztens becslés a **várható értékre**.

Speciális eset: a **relatív gyakoriság** konzisztens becslés a **valószínűségre**.

Nevezetes eloszlások:

- Poisson-eloszlás  $\lambda$  paraméterére az átlag torzítatlan, konzisztens
- a normális eloszlás  $m$  paraméterére az átlag torzítatlan és konzisztens; a  $\sigma$  paraméterre a tapasztalati szórás és a korrigált tapasztalati szórás konzisztensek, de nem torzítatlanok;  $\sigma^2$ -re  $s_n^{*2}$  torzítatlan
- exponenciális eloszlás:  $1/\bar{X}$  konzisztens  $\lambda$ -ra, de nem torzítatlan a paraméterre
- exponenciális eloszlás:  $(n+1) \cdot \min(X_1, \dots, X_n)$  torzítatlan, de nem konzisztens a várható értékre (vagyis  $1/\lambda$ -ra).