

билет 5

Свойства выборочных моментов (среднего, дисперсии) – несмещенность, состоятельность.

Оценка $\hat{\theta}$ параметра θ называется несмещенной (без систематических ошибок), если математическое ожидание оценки совпадает с истинным значением θ :

$$M(\hat{\theta}) = \theta$$

Если это равенство не имеет места, то оценка $\hat{\theta}$ называется смещенной (с систематическими ошибками).

Выборочное среднее \bar{x} является несмещенной оценкой математического ожидания $M(X)$,

несмещенных оценкой дисперсии σ^2 – исправленная выборочная оценка дисперсии s^2 .