Kwantowa Teoria Pomiaru i Estymacji

Seria 3

do oddania na 3.11.2014

Zadanie 1 (3 pkt) Rozważ model pomiaru dwóch niezależnych zmiennych losowych x_1, x_2 t.że:

$$x_1 \sim \mathcal{N}(\theta, \sigma^2) \tag{1}$$

$$x_2 \sim \begin{cases} \mathcal{N}(\theta, \sigma^2) & \theta \geq 0 \\ \mathcal{N}(\theta, 2\sigma^2) & \theta < 0 \end{cases} \tag{2}$$

gdzie zapis $x \sim \mathcal{N}(\theta, \sigma^2)$ oznacza, że rozkład prawdopodobieństwa zmiennej losowe x jest rozkładem gaussowskim o średniej θ i wariancji σ^2. Przyjmując, że σ jest znana a estymowanym parametrem jest θ postaraj się wykazać korzystając z nierówności Cramera-Rao, że optymalnym estymatorem w obszarze $\theta \geq 0$ jest $\tilde{\theta}(x_1, x_2) = \frac{1}{2}(x_1 + x_2)$, a w obszarze $\theta < 0$ jest $\tilde{\theta}(x_1, x_2) = \frac{1}{3}(2x_1 + x_2)$. Tym samym wykażesz, że nie istniej jeden estymator gwarantujący minimalną wariancję w całym obszarze parametrów.

Zadanie 2 (2 pkt) Rozważ uogólnienie nierówności Cramera-Rao na przypadek estymacji funkcji od parametru $g(\theta)$. Wykaż, że jeśli $p_\theta(x)$ jest rodziną rozkładów prawdopodobieństwa obserwowanych zdarzeń to dla dowolnego nieobciążonego estymatora $\tilde{g}(x)$ zachodzi:

$$\Delta^2 \tilde{g} \geq \frac{g'(\theta)^2}{F} \tag{3}$$

gdzie $g'(\theta) = \frac{\mathrm{d}g(\theta)}{\mathrm{d}\theta}$ a F jest informacją Fishera dla $p_\theta(x)$.

Zadanie 3 (2 pkt) Mówimy, że $p_\theta(x)$ należy do rodziny wykładniczych rozkładów prawdopodobieństwa wtedy i tylko wtedy gdy:

$$p_\theta(x) = e^{a(\theta) + b(x) + c(\theta)d(x)} \tag{4}$$

Wykaż, że w tym przypadku zawsze istnieje funkcja $g(\theta)$ dla której istnieje estymator efektywny tzn. wysycający nierówność Cramera-Rao. Podaj tę funkcję. Bardzo wiele znanych rozkładów prawdopodobieństwa należy do tej rodziny (patrz `http://en.wikipedia.org/wiki/Exponential_family`).

Zadanie 4 (3 pkt) Rozważ model probabilistyczny, w którym obserwowane jest N niezależnych zmiennych losowych x_n, $(n = 0, \ldots, N-1)$, gdzie $x_n \sim \mathcal{N}(an + b, \sigma^2)$ (zależność liniowa + szum gaussowski).

a) Zapisz macierz Fishera odpowiadającą zagadnieniu estymacji dwu-parametrowej w której staramy się wyestymować parametry prostej a i b.

b) Zapisz dolne ograniczenie wynikające z nierówności Cramera-Rao na najmniejszą możliwą niepewność estymacji $\Delta\tilde{a}$ i $\Delta\tilde{b}$. Który z parametrów jest "łatwiejszy" do wyestymowania?

c) Podaj estymatory wysycające tę nierówność. Sprawdź czy to te same estymatory, które wynikają z zastosowanie heurystycznej metody najmniejszych kwadratów