

Stima con metodo di massima verosimiglianza

Vogliamo determinare il parametro θ della densità $f_\theta(x)$ del campione X_1, \dots, X_n , avendo a disposizione una misurazione x_1, \dots, x_n .

Definiamo la verosimiglianza del campione:

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

La stima di massima verosimiglianza $\hat{\theta}$, se esiste, è il punto di massimo della funzione:

$$\theta \mapsto L_\theta(x_1, \dots, x_n).$$