

MAXIMUM-LIKELIHOOD-SCHÄTZER

Ziel ist die Konstruktion von Maximum-Likelihood-Schätzern.
 Dazu wird jeweils in einem n -fachen Produktmodell gearbeitet,
 gegeben ist die Dichte einer einzelnen Komponente, aber das
 genügt, um die gemeinsame Dichte zu bestimmen (die
 Bezeichnung P_θ für so eine einzelne Dichte hat keine Obern, das
 sollte der Likelihoodfkt. vorbehalten sein). Für jedes θ ist

$$(x_1, \dots, x_n) \mapsto P_\theta(x_1, \dots, x_n)$$

die Dichte des Produktmodells, für festes (x_1, \dots, x_n) als Funktion
 in θ die Likelihoodfkt. Das Maximum (in θ) sollte dann
 sauber nachgewiesen werden.

Für lange Datenreihen sind R, Matlab, Maple, etc. hilfreich.