

Estymacja entropii metodą selekcji modelu

Streszczenie

Niech f będzie gęstością prawdopodobieństwa o nośniku $[0, 1]$ taką, że jej entropia $K(f) = \int_0^1 f \log f$ jest skończona. W referacie przedstawione zostaną wyniki teoretyczne dotyczące zgodności i rozkładu granicznego estymatorów entropii $K(f)$ otrzymanych w wyniku uprzedniej selekcji modelu, gdzie za listę dostępnych modeli przyjmujemy wykładnicze rodziny rozkładów.