

# Estadística V

Examen Final - Aclaraciones

Junio de 1998

**Problema 3, apartado d).** Una compañera vuestra objeta a la cuestión 3(d), sobre la base de que el enunciado del problema no suministra función de pérdida. Tiene mucha razón, porque efectivamente la definición de minimaxidad que manejamos se refiere al riesgo de un estimador, que a su vez requiere especificar la función de pérdida.

Yo tenía en mente una pérdida cuadrática,  $|\hat{\theta} - \theta|^2$ . En realidad, cualquier función monótona de  $|\hat{\theta} - \theta|$  daría lugar al mismo resultado. Añadidlo como supuesto para resolver dicho apartado.

Se me preguntaba también si estaba suponiendo alguna distribución *a priori* sobre el parámetro. Podéis suponer una *a priori* difusa, aunque no creo que os hace falta. La condición de minimax de un estimador depende de su función de *riesgo*, no de su *riesgo de Bayes*.

ft.