

Stima con metodo dei momenti

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 :

- si scrivono i momenti teorici in dipendenza del parametro θ :

$$E_\theta[X^k] = \int_{-\infty}^{+\infty} x^k f_\theta(x) dx$$

- si eguagliano con i *momenti empirici*:

$$E_\theta[X^k] = \sum_{i=1}^n \frac{x_i^k}{n}$$

- se possibile, si ricava il parametro $\tilde{\theta}$ da questa equazione.