

استقلال توابع هم‌وردا و ناوردا در خانواده نرمال تعمیم‌یافته

مهدی شمس^۱

تاریخ دریافت: ۱۳۹۵/۱۱/۲۶

تاریخ پذیرش: ۱۳۹۷/۶/۲۶

چکیده:

در این مقاله با فراخوانی توزیع نرمال تعمیم‌یافته که یک خانواده‌ی نمایی عمومی با پارامتر مکان و مقیاس است، یک شرط لازم و کافی برای استقلال یک آماره‌ی ناوردا‌ی مکانی از آماره‌ی بسنده‌ی هم‌وردای مکانی که یک برآوردگر ماکسیمم درست‌نمایی است، ارائه می‌شود. در پایان نشان داده می‌شود که عکس این مطلب به جز در حالت‌های مجانبی صحیح است.

واژه‌های کلیدی: قضیه‌ی باسو، خانواده‌ی نمایی، پارامترهای مکان و مقیاس.

۱ مقدمه

ماکسیمم درست‌نمایی برای پارامتر مقیاس باشد، آن‌گاه تحت شرایط نظم توزیع نمایی (نرمال) با میانگین یک (صفر) است که [۱۳] حقیقت اخیر را در حالت چندمتغیره تعمیم دادند. [۹] تحت شرایط نظم نشان دادند که اگر برای اندازه نمونه $n = 4$ برآوردگر ماکسیمم درست‌نمایی برای یک پارامتر مکان برابر میانه نمونه شود، آن‌گاه توزیع حاصل، توزیع لاپلاس است. در مورد شرایط وجود برآوردگر ماکسیمم درست‌نمایی در خانواده‌های گروه یک پارامتری [۴]، توزیع‌های کروی [۳] و توزیع‌های گسسته [۱۴، ۱۵] تحقیقات ارزنده‌ای انجام شده است که برای اطمینان بیشتر می‌توان به منابع اشاره شده رجوع کرد. همچنین در این مقاله نشان داده می‌شود که اگر در یک نمونه تصادفی به اندازه $n = 2$ ، تفاضل دو نمونه از صورت کلی برآوردگر ماکسیمم درست‌نمایی متناظر با پارامتر مکان توزیع نرمال تعمیم‌یافته مستقل باشد، آن‌گاه دو متغیر دارای توزیع نرمال تعمیم‌یافته هستند و در پایان به کمک قضیه‌ی باسو مثال نقضی برای عدم برقراری این گزاره در حالت‌های مجانبی به دست آورده می‌شود. در این مثال نقض از دو متغیر تصادفی مستقل و هم‌توزیع هندسی استفاده می‌شود، [۶] نشان داد عکس این حالت برقرار است و استقلال تفاضل دو نمونه تصادفی از صورت کلی برآوردگر ماکسیمم درست‌نمایی متناظر با پارامتر مکان توزیع

قضیه‌ی باسو [۱] یکی از قضیه‌های مشهور آمار است که باعث کشف ارتباط بین بسندگی، آماره‌های کمکی و استقلال شد. با استفاده از این قضیه وجود استقلال بدون محاسبه توزیع توأم دو آماره حاصل می‌شود. [۷] حالات خاصی از قضیه‌ی باسو (و عکس آن) در خانواده‌هایی با چگالی خاص را بیان کرده‌اند که در آنها استقلال آماره‌ی بسنده‌ی کامل و آماره‌ی کمکی نتیجه می‌شود. در این مقاله در ابتدا یک خانواده‌ی نمایی عمومی به نام توزیع نرمال تعمیم‌یافته را معرفی می‌کنیم که بیشتر توزیع‌های معروف آماری نظیر نرمال، نمایی دم‌بریده، گاما، لگ‌نرمال، وایبل و یکنواخت را در بر می‌گیرد و سپس در این خانواده بر اساس یک نمونه تصادفی، یک شرط لازم و کافی برای استقلال آماره‌ی بسنده‌ی هم‌وردای مکانی که یک برآوردگر ماکسیمم درست‌نمایی است از هر آماره‌ی دلخواه ناوردا‌ی مکانی مطرح می‌شود (که به نوعی یک حالت از قضیه‌ی باسو و عکس آن است) و در حالت خاص نتایج ثابت شده در [۱۰، ۱۱] را شامل می‌شود. به‌ازای یک پارامتر خاص در توزیع نرمال تعمیم‌یافته مشاهده می‌شود که برآوردگر ماکسیمم درست‌نمایی برای پارامتر مکان برابر میانگین نمونه است که این نتیجه با نتایج [۸، ۱۳] مطابقت دارد. [۱۶] نشان داد که اگر گشتاور اول (دوم) نمونه، یک برآوردگر

^۱ عضو هیئت علمی گروه آمار، دانشگاه کاشان، ایران

قضیه ۳.۱. [۷] فرض کنید $X_1, \dots, X_n$ یک نمونه تصادفی از جمعیتی با تابع چگالی

$$f_{\theta}(x) = Q(\theta) M(x) I_{(a(\theta), b(\theta))}(x)$$

باشد به طوری که پارامتر نامعلوم θ متعلق به فواصل غیر تهی است و علاوه بر برقراری شرط ۱ قضیه ۱.۱، a' و b' پیوسته هستند و $\sup a(\theta) = \inf b(\theta)$. همچنین یکی از شرایط زیر برقرار باشد:

۱. a ثابت و b اکیداً یکنوا است (یا برعکس).

۲. a اکیداً نزولی و b اکیداً صعودی است (یا برعکس).

در صورت برقراری شرط ۱ یا ۲، به ترتیب آماره‌های

$$Z = X_{(n)}$$

$$Z^* = X_{(1)}$$

یا

$$Z = \max \{a^{-1}(X_{(1)}), b^{-1}(X_{(n)})\}$$

$$Z^* = \min \{a^{-1}(X_{(1)}), b^{-1}(X_{(n)})\}$$

آماره بسنده کامل برای θ است و شرط لازم و کافی برای استقلال از آماره U آن است که U آماره کمکی باشد.

قضیه ۴.۱. [۷] فرض کنید $X_1, \dots, X_n$ یک نمونه تصادفی از جمعیتی با تابع چگالی

$$f_{\theta}(x) = Q(\theta) M(x) I_{(a(\theta), b(\theta))}(x)$$

باشد به طوری که در بردار پارامتر نامعلوم $\theta = (\theta_1, \theta_2)$ اعضای θ_1 و θ_2 متعلق به بازه‌های غیر تهی هستند و علاوه بر شرط ۱ قضیه ۱.۱، شرط زیر برقرار هستند:

a و b نسبت به هر یک از مؤلفه‌ها یکنوا و پیوسته باشند و برد (a, b) غیر تهی باشد.

در این صورت $Z = (X_{(1)}, X_{(n)})$ آماره بسنده کامل توأم برای θ است و شرط لازم و کافی برای استقلال آماره دلخواه U و Z این است که U یک آماره کمکی باشد.

نرمال تعمیم‌یافته منجر به این حقیقت می‌شود که متغیرها دارای توزیع هندسی هستند. در ابتدا به حالات خاصی از قضیه باسو (و عکس آن) مطرح شد [۷]، اشاره می‌شود. قضیه‌ها بدون اثبات ارائه می‌شود. خواننده برای مشاهده اثبات قضایا به [۷] مراجعه کند.

قضیه ۱.۱. [۷] فرض کنید $X_1, \dots, X_n$ یک نمونه تصادفی از جمعیتی با تابع چگالی

$$f_{\theta}(x) = Q(\theta) M(x) e^{\sum_{j=1}^q P_j(\theta) K_j(x)} I_{(a, b)}(x) \quad ; q < n$$

باشد، به طوری که $\theta = (\theta_1, \dots, \theta_q)$ بردار پارامترهای نامعلوم است و شرایط نظم به صورت زیر برقرار است:

۱. M تابعی نامنفی و پیوسته است.

۲. K'_j ها پیوسته و مستقل خطی هستند.

۳. P_j ها پیوسته‌اند و برد $(P_1, \dots, P_q)$ که زیرمجموعه $\mathbb{R}^q$ است، شامل فواصل q -بعدی غیر تهی است.

۴. a و b به θ_j ها بستگی ندارند.

در این صورت اگر $Z_j = \sum_{i=1}^n K_j(X_i)$ که در آن $j = 1, \dots, q$ ، شرط لازم و کافی برای استقلال آماره دلخواه U از آماره بسنده کامل توأم $Z = (Z_1, \dots, Z_q)$ این است، U یک آماره کمکی باشد.

قضیه ۲.۱. [۷] فرض کنید $X_1, \dots, X_n$ یک نمونه تصادفی از جمعیتی با تابع چگالی

$$f_{\theta}(x) = Q_1(\theta) M_1(x) \exp \left(\sum_{j=1}^q P_j(\theta) K_j(x) \right) ; \quad q < n$$

باشد، به طوری که $\theta = (\theta_1, \dots, \theta_q)$ و علاوه بر شرط ۳ قضیه ۱.۱، شرایط نظم زیر نیز برقرار باشد:

۱. K_j ها مستقل‌اند و مشتقات جزئی آنها نسبت به هر یک از اجزای نمونه پیوسته هستند.

۲. دامنه f_{θ} به پارامتر بستگی نداشته باشد.

در این صورت $Z = (Z_1, \dots, Z_q)$ یک آماره بسنده کامل توأم برای θ است و شرط لازم و کافی برای استقلال آماره دلخواه U و Z این است که U آماره کمکی باشد.

قضیه ۵.۱. [۷] فرض کنید $X_1, \dots, X_n$ یک نمونه تصادفی از جمعیتی با تابع چگالی

$$f_Y(y) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} \exp\left\{-\frac{1}{2\sigma^2}(y-\theta)^2\right\}; \quad y \in \mathbb{R} \quad \gamma \rightarrow 0,$$

$$f_Y(y) = \frac{1}{\sigma} \exp\left\{-\frac{1}{\sigma}(y-\theta)\right\}; \quad y > \theta \quad \gamma \rightarrow -\infty,$$

$$f_Y(y) = \frac{1}{\sigma} \exp\left\{+\frac{1}{\sigma}(y-\theta)\right\}; \quad y < \theta \quad \gamma \rightarrow +\infty$$

میل می کند و برای سادگی به ترتیب از نمادهای $N(\theta, \sigma^2, 0)$ ، $N(\theta, \sigma^2, -\infty)$ و $N(\theta, \sigma^2, +\infty)$ استفاده می شود. در نتیجه می توان نماد $N(\theta, \sigma^2, \gamma)$ را روی $\mathbb{R}$ و $\theta \in \mathbb{R}$ و $\sigma^2 > 0$ و $\gamma \in \mathbb{R}^* = \mathbb{R} \cup \{-\infty, +\infty\}$ نیز تعریف کرد. این خانواده از توزیع ها یک خانواده نمایی یک پارامتری در θ (و یا σ^2) و یک خانواده نمایی دو پارامتری در (θ, σ^2) هستند. حال اگر $X_1, \dots, X_n$ یک نمونه تصادفی از توزیع $N(\theta, \sigma^2, \gamma)$ باشد، آن گاه آماره بسنده (برآوردگر ماکسیم درست نمایی) برای θ که در آن پارامترهای σ^2 و γ ثابت اند برابر است با:

$$M_\gamma(X_1, \dots, X_n) = \begin{cases} \frac{1}{\gamma} \ln\left(\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n e^{\gamma x_i}\right), & \gamma \in \mathbb{R} - \{0\} \\ \bar{X}, & \gamma = 0 \\ X_{(n)}, & \gamma = +\infty \\ X_{(1)}, & \gamma = -\infty \end{cases}$$

که آن را اصطلاحاً میانگین مرتبه γ گوئیم [۴]. این تابع برای مقادیر ثابت نمونه یک تابع اکیداً صعودی و پیوسته از γ است، مگر این که همه X_i ها مساوی باشند که در این حالت $M_\gamma(X_1, \dots, X_n)$ اثبات است. برای یک نمونه تصادفی به اندازه $n \geq 2$ ثابت وجود و یا عدم وجود یک آماره بسنده کامل برای پارامتر مکان θ در خانواده $N(\theta, \sigma^2, \gamma)$ یک مسئله حل نشده است [۵]. حالت خاص توزیع $N(\theta, \sigma^2, 0)$ با نتیجه [۸] (و در حالت چندمتغیره [۱۳]) مبنی بر این که اگر برآوردگر ماکسیم درست نمایی برای یک پارامتر مکان برابر میانگین نمونه شود، آن گاه توزیع نرمال (نرمال چندمتغیره) است منطبق هستند.

تذکر ۱.۲. اگر متغیر تصادفی Y دارای توزیع $N(\theta, \sigma^2, \gamma)$ باشد، آن گاه توزیع $X = e^Y$ با نماد $L(\theta, \sigma^2, \gamma)$ نمایش داده می شود که در این توزیع θ پارامتر مقیاس است. در حالت خاص $L(\theta, \sigma^2, 1)$ توزیع گاما، $L(\theta, \sigma^2, 0)$ توزیع لگ نرمال $L(\theta, 1, +\infty)$ و $L(\theta, 1, -\infty)$ (و $\gamma > 0$) توزیع وایبل $L(\theta, \frac{1}{\sigma^2} \Psi'(\frac{1}{\gamma}), \gamma)$

$$f_\theta(x) = Q(\theta) M(x) \exp\left(\sum_{j=3}^q P_j(\theta_3, \dots, \theta_q) K_j(x)\right)$$

$$I_{(a(\theta_1, \theta_2), b(\theta_1, \theta_2))}(x), \quad q < n$$

باشد به طوری که هر یک از مختصات بردار پارامتر $\theta = (\theta_1, \dots, \theta_q)$ متعلق به بازه های غیرتهی است، شرایط ۱ تا ۴ قضیه ۱.۱ و شرط قضیه ۴.۱ برقرار هستند و $Z_1 = X_{(1)}$ و $Z_j = \sum_{i=1}^n K_j(X_i)$ که در آن $j = 3, \dots, q$ در این صورت $Z = (Z_1, \dots, Z_q)$ یک آماره بسنده کامل توأم برای θ است و شرط لازم و کافی برای استقلال آماره دلخواه Z و U این است که U یک آماره کمکی باشد.

۲ استقلال در خانواده های نمایی با پارامترهای مکان و مقیاس

فرض کنید متغیر تصادفی X دارای توزیع گاما با تابع چگالی

$$f_X(x) = \frac{1}{\beta^\alpha \Gamma(\alpha)} e^{-x/\beta} x^{\alpha-1}; \quad x > 0, \alpha, \beta > 0$$

است. در این صورت تابع چگالی متغیر تصادفی $Y = \frac{1}{\gamma} \ln(X)$ برای $\gamma \neq 0$ به صورت

$$f_Y(y) = \frac{|\gamma| \alpha^\alpha}{\Gamma(\alpha)} \exp\left\{-\alpha e^{\gamma(y-\theta)} + \alpha \gamma(y-\theta)\right\}$$

خواهد بود، که در آن پارامتر مکان برای خانواده توابع چگالی $f_Y(y)$ است [۵]. میانگین و واریانس Y را می توان به صورت

$$E(Y) = \theta + \frac{1}{\gamma} [\Psi(\alpha) - \ln(\alpha)]$$

$$Var(Y) = \sigma^2 = \frac{1}{\gamma^2} \Psi'(\alpha)$$

محاسبه کرد که در آن $\Psi(\alpha)$ و $\Psi'(\alpha)$ اولین و دومین مشتق $\ln(\Gamma(\alpha))$ هستند. توزیع Y با نماد $N(\theta, \sigma^2, \gamma)$ نشان داده می شود که در آن $\theta \in \mathbb{R}$ ، $\sigma^2 > 0$ و $\gamma \neq 0$ ، در حالت خاص این توزیع وقتی $\gamma \rightarrow 0$ یا $\gamma \rightarrow -\infty$ یا $\gamma \rightarrow +\infty$ به ترتیب به

توزیع یکنواخت $U(0, \theta)$ هستند.

تحقیقات متنوع راجع به پارامترهای مکان و مقیاس در خانواده‌های نمایی باعث شده که ایده‌ای برای عمومیت قضیهٔ باسو پیدا شود که در این‌جا به آن اشاره می‌شود. می‌دانیم در خانواده‌های نمایی وقتی بعد فضای پارامتر و بعد آمارهٔ بسنده یکسان باشد، آمارهٔ بسنده، کامل است [۱۲]. از طرف دیگر در خانواده‌های با پارامترهای مکان، مقیاس و ترکیبی از این دو، آماره‌های کمکی به راحتی به دست می‌آیند. به‌عنوان نمونه اگر $X_1, \dots, X_n$ یک نمونهٔ تصادفی از توزیعی با پارامتر مکان θ باشد، آن‌گاه توزیع توأم تفاضل‌های $X_1 - X_2, \dots, X_{n-1} - X_n$ به پارامتر θ بستگی ندارد. بنا بر این طبق قضیهٔ باسو آمارهٔ بسندهٔ کامل T برای θ از هر تابعی از تفاضل‌های X_i ‌ها مستقل است [۲]. به‌طور مشابه توزیع توأم نسبت‌های X_i بستگی به پارامتر مقیاس ندارد و توزیع توأم نسبت‌های تفاضل‌ها به پارامتر مکان-مقیاس بستگی ندارد. بنا بر این عمده‌ترین کاربردهای قضیهٔ باسو در حالت یک‌متغیره، در خانواده‌های نمایی (با پارامترهای مکان، مقیاس و مکان-مقیاس) است، زیرا در این خانواده‌ها بعد فضای پارامتر با بعد آمارهٔ بسنده یکسان است و در نتیجه آمارهٔ بسنده، کامل است و لذا می‌توان از قضیهٔ باسو استفاده کرد. به‌عنوان مثال اگر $X_1, \dots, X_n$ یک نمونهٔ تصادفی از توزیع لگ‌نرمال $L(1, \sigma^2, 0)$ باشد، آن‌گاه $\sum_{i=1}^n \ln X_i^2$ هر تابع $g(X_1, \dots, X_n)$ که در آن به‌ازای هر λ داشته باشیم $g(X_1, \dots, X_n) = g(X_1^\lambda, \dots, X_n^\lambda)$ مستقل است، زیرا σ پارامتر مقیاس در توزیع $N(0, \sigma^2, 0)$ است. شایان ذکر است که قضیهٔ باسو علاوه بر موارد بالا در خانواده‌هایی که پارامتر مکان و یا مقیاس ندارند نیز استفاده می‌شود.

در این مقاله ابتدا ناوردایی مکانی و مقیاسی تعریف می‌شود. فرض کنید $X_1, \dots, X_n$ یک نمونهٔ تصادفی از یک مدل ناوردای مکانی (مقیاسی) است هرگاه متغیرهای مستقل و هم‌توزیع $W_1, \dots, W_n$ وجود داشته باشند به‌طوری که به‌ازای یک θ داشته باشیم:

$$(X_1, \dots, X_n) \stackrel{d}{=} (W_1 + \theta, \dots, W_n + \theta)$$

$$((X_1, \dots, X_n) \stackrel{d}{=} (\theta W_1, \dots, \theta W_n)).$$

در این‌جا توزیع W_i ‌ها ثابت و به پارامتر θ بستگی ندارد. همچنین آمارهٔ U را ناوردای مکانی (مقیاسی) گویند هرگاه به‌ازای λ و هر $x_1, \dots, x_n$ داشته باشیم:

$$U(\lambda + x_1, \dots, \lambda + x_n) = U(x_1, \dots, x_n)$$

$$(U(\lambda + x_1, \dots, \lambda + x_n) = U(x_1, \dots, x_n))$$

و آمارهٔ T را هم‌وردای مکانی (مقیاسی) گویند هرگاه به‌ازای λ و هر $x_1, \dots, x_n$ داشته باشیم:

$$U(\lambda + x_1, \dots, \lambda + x_n) = U(x_1, \dots, x_n) + \lambda$$

$$(U(\lambda x_1, \dots, \lambda x_n) = \lambda U(x_1, \dots, x_n)) [۱۲].$$

گزارهٔ ۲.۲. [۱۲]. آمارهٔ ناوردای مکانی (مقیاسی) برای مدل ناوردای مکانی (مقیاسی)، یک آمارهٔ کمکی است.

اثبات. گزاره در حالت مکان ثابت می‌شود (در حالت مقیاس مشابه است). متغیرهای مستقل و هم‌توزیع $W_1, \dots, W_n$ وجود دارند به‌طوری که به‌ازای یک θ داریم

$$(X_1, \dots, X_n) \stackrel{d}{=} (W_1 + \theta, \dots, W_n + \theta)$$

و در پی آن می‌توان نتیجه گرفت:

$$\begin{aligned} U(X_1, \dots, X_n) &\stackrel{d}{=} U(W_1 + \theta, \dots, W_n + \theta) \\ &= U(W_1, \dots, W_n) \end{aligned} \quad (۱)$$

که تساوی (۱) به‌دلیل ناوردای مکانی بودن آمارهٔ U است. با توجه به این‌که توزیع W_i ‌ها به پارامتر θ بستگی ندارد، در نتیجه توزیع آماره U وابسته به θ نیست و از این رو آمارهٔ کمکی است. $\square$

به‌عنوان مثال اگر $X_1, \dots, X_n$ نمونهٔ تصادفی از توزیع $U(0, \theta)$ باشد که $\theta > 0$ ، از این‌که برای نمونهٔ تصادفی $W_1, \dots, W_n$ از توزیع $U(0, 1)$ ، $U(0, 1) \stackrel{d}{=} X_i$ نتیجه می‌شود که خانواده توزیع‌های $U(0, \theta)$ از یک مدل مقیاس هستند و چون برای آمارهٔ

$$U = \frac{X_1 + \dots + X_n}{X_1}$$

نتیجه می شود

$$U(\lambda X_1, \dots, \lambda X_n) = \frac{\lambda X_1 + \dots + \lambda X_n}{\lambda X_1} \\ = U(X_1, \dots, X_n)$$

آماره U ناوردای مقیاسی و طبق گزاره ۲.۲ یک آماره کمکی است. [۱۰، ۱۱] نتایجی را برای توزیع نرمال و گاما به دست آمده است که از قضیه ۱.۱ نتیجه می شوند:

نتیجه ۳.۲. [۱۱] اگر $X_n, \dots, X_1$ یک نمونه تصادفی از توزیع نرمال باشد، $\bar{X}$ و $g(X_1, \dots, X_n)$ مستقل هستند، اگر و فقط اگر به ازای هر λ داشته باشیم:

$$g(X_1, \dots, X_n) \stackrel{d}{=} g(\lambda + X_1, \dots, \lambda + X_n).$$

نتیجه ۴.۲. [۱۰] اگر $X_n, \dots, X_1$ یک نمونه تصادفی از توزیع گاما باشد، $\bar{X}$ و $g(X_1, \dots, X_n)$ مستقل هستند، اگر و فقط اگر به ازای هر λ داشته باشیم:

$$g(X_1, \dots, X_n) \stackrel{d}{=} g(\lambda X_1, \dots, \lambda X_n).$$

به راحتی با استفاده از قضیه باسو و قضیه ۱.۱ می توان نتایج اخیر را در حالت کلی و در خانواده

$$P = \{N(\theta, \sigma^2, \gamma) : \theta \in \mathbb{R}, \sigma^2 > 0, \gamma \in \mathbb{R}^*\}$$

تعمیم داد که در قضیه زیر به آن اشاره شده است.

قضیه ۵.۲. [۱۰] اگر $X_n, \dots, X_1$ یک نمونه تصادفی از توزیع $N(\theta, \sigma^2, \gamma)$ باشد، $M_\gamma(X_1, \dots, X_n)$ از $g(X_1, \dots, X_n)$ مستقل است اگر و تنها اگر که به ازای هر λ داشته باشیم:

$$g(X_1, \dots, X_n) \stackrel{d}{=} g(\lambda + X_1, \dots, \lambda + X_n).$$

تذکر ۶.۲. همان طور که در قضیه بالا مشاهده می شود برآوردگر هموردای مکانی $M_\gamma(X_1, \dots, X_n)$ از آماره ناوردای $g(X_1, \dots, X_n)$ مستقل است. اثبات هموردای مکانی بودن $M_\gamma(X_1, \dots, X_n)$ از تساوی زیر واضح است:

$$M_\gamma(X_1 + c, \dots, X_n + c) = \begin{cases} \frac{1}{\gamma} \ln \left(\frac{1}{n} e^c \sum_{i=1}^n e^{\gamma x_i} \right) & \gamma \in \mathbb{R} - \{0\} \\ \bar{X} + c & \gamma = 0 \\ X_{(n)} + c & \gamma = +\infty \\ X_{(1)} + c & \gamma = -\infty \end{cases} \\ = M_\gamma(X_1, \dots, X_n) + c.$$

به طور مشابه $M_\gamma(X_1, \dots, X_n)$ فقط در حالت های $\gamma = 0, \pm\infty$ برآوردگر هموردای مقیاسی است.

نتایج ۳.۲ و ۴.۲، حالت خاص قضیه ۵.۲ هستند که با قرار دادن $\gamma = 0$ برای توزیع نرمال و $\gamma = 1$ برای توزیع گاما حاصل می شوند.

گزاره ۷.۲. [۵] اگر X و Y مستقل و برای برخی مقادیر حقیقی γ متغیرهای تصادفی $X - Y$ و $M_\gamma(X, Y)$ مستقل باشند، آن گاه X و Y هر دو دارای توزیع $N(\theta, \sigma^2, \gamma)$ هستند.

گزاره ۷.۲ به ازای هر $\gamma \in \mathbb{R}$ صحیح است ولی برای $\gamma \rightarrow \pm\infty$ صدق نمی کند. با کمک قضیه باسو مثال نقضی برای عدم برقراری این گزاره در حالت $\gamma \rightarrow \pm\infty$ به دست آورده شده است.

مثال ۸.۲. اگر X و Y دو متغیر تصادفی مستقل با توزیع هندسی $Ge(\theta)$ باشند، آن گاه تابع چگالی احتمال توأم X و Y به صورت زیر است:

$$P_\theta(X = x, Y = y) = (1 - p)^2 p^{x+y-2\theta} \\ I_{\{\theta, \theta+1, \dots\} \times \{\theta, \theta+1, \dots\}}(x, y).$$

اگر $\gamma \rightarrow -\infty$ ، آن گاه $M_{-\infty}(X, Y) = \min(X, Y)$ آماره بسنده کامل برای θ است و از این رو طبق قضیه باسو از آماره کمکی $X - Y$ مستقل است؛ در حالی که X و Y دارای توزیع $N(\theta, \sigma^2, -\infty)$ نیست. (ذکر این نکته ضروری است که [۶] نشان داد عکس مطلب نیز برقرار است، یعنی اگر $\min(X, Y)$ و $X - Y$ مستقل باشند، آن گاه X و Y دارای توزیع هندسی هستند.)

۳ نتیجه گیری

در این مقاله به کمک قضیه باسو در یک خانواده نمایی عمومی یعنی توزیع نرمال تعمیم یافته با پارامتر مکان و مقیاس، استقلال آماره بسنده هموردای مکانی از یک آماره ناوردای مکانی مورد بررسی قرار گرفت. بررسی استقلال در حالت مقیاس و مکان - مقیاس و همچنین تحت گروه تبدیلات دیگر در این خانواده و همچنین اثبات وجود و یا عدم وجود یک آماره بسنده کامل در این خانواده از مطالبی است که می تواند مسیر جدیدی را برای محققان علاقه مند باز کند.

مراجع

- [1] Basu, D. (1955). On statistics independent of a complete sufficient statistic, *Sankhya*, **15**, 377-380.
- [2] Basu, D. (1977). On the elimination of nuisance parameters, *Journal of the American Statistical Association*, **72**, 355-366.
- [3] Duerinckx, M. and Ley, C. (2012). Maximum likelihood characterization of rotationally symmetric distributions on the sphere, *Sankhya A*, **74(2)**, 249-262.
- [4] Duerinckx, M. and Ley, C. and Swan, Y. (2014). Maximum likelihood characterization of distributions Bernoulli, *Euclid*, **20(2)**, 775-802.
- [5] Ferguson, T. S. (1962a). Location and scale parameters in exponential families of distributions, *Annals of Mathematical Statistics*, **33**, 986-1001.
- [6] Ferguson, T. S. (1962b). A characterization of the geometric distribution, *Annals of Mathematical Statistics*, **33**, 1207.
- [7] Hogg, R. V. and Craig, A. T. (1956). Sufficient statistics in elementary distribution theory, *Sankhya*, **17**, 209-216.
- [8] Hürlimann, W. (2013). *A Characterization of the Compound Multiparameter Hermite Gamma Distribution via Gauss's Principle*, Hindawi Publishing Corporation The Scientific World Journal Volume.
- [9] Kagan, A. M., Linnik, Y. V. and Rao, C. R. (1973). *Characterization Problems in Mathematical Statistics*, John Wiley Sons, New York-London-Sydney.
- [10] Laha, R. G. (1954). On a characterisation of the gamma distribution, *Annals of Mathematical Statistics*, **25**, 784-787.
- [11] Laha, R. G. (1956). On Some properties of the normal and gamma distributions, *Proceedings of American Mathematical Society*, **7**, 172-174.
- [12] Lehmann, E. L. and Romano, J. P. (2005). *Testing Statistical Hypotheses*, 3rd edition. Springer, New York.
- [13] Marshall, A. W. and Olkin, I. (1993). Maximum likelihood characterizations of distributions, *Statistica Sinica*, **3**, 157-171.
- [14] Puig, P. (2003). Characterizing additively closed discrete models by a property of their MLEs, with an application to generalized Hermite distributions, *Journal of the American Statistical Association*, **98**, 687-692.

- [15] Puig, P. and Valero, J. (2006). Count data distributions: some characterizations with applications, *Journal of the American Statistical Association*, **101**, 332-340.
- [16] Teicher, H. (1961). Maximum likelihood characterization of distributions, *Annals of Mathematical Statistics*, **32**, 1214-1222.