

Detekcja niegaussowskości

Streszczenie

Przedstawimy konstrukcję nowego testu statystycznego w problemie badania zgodności rozkładu obserwacji z rozkładem normalnym. Przedyskutujemy innowacyjne podejście do konstrukcji statystyki testowej. Omówimy reprezentatywne wyniki przeprowadzonych, obszernych, badań symulacyjnych. Wiele uwagi poświęcimy detekcji, ważnym w zastosowaniach, symetrycznym alternatywom oraz konstrukcji adekwatnej statystyki testowej.

Przyjrzymy się również problemowi testowania hipotezy prostej, \mathbf{H}^* : obserwacje pochodzą ze standardowego rozkładu normalnego $N(0, 1)$, konstruując przy tym odpowiednią statystykę testową.

Zaprezentujemy wyniki asymptotyczne mówiące o rozkładzie statystyk testowych i zgodności, dla szerokiej klasy alternatyw, odpowiadających im testów.