

# Stochastyczne uporządkowanie estymatorów

## Streszczenie

Niech  $\mathbf{X} = (X_1, \dots, X_n)$  będzie próbą z rozkładu o gęstości  $f(x; \theta)$  (absolutnie ciągłej względem miary Lebesgue'a bądź miary liczącej), gdzie  $\theta \in \Theta \subset \mathbf{R}$ .

W referacie omówimy problem uporządkowania estymatorów nieznanego parametru  $\theta$  względem wybranych porządków stochastycznych i metod estymacji, zwracając przy tym szczególną uwagę na aspekt zastosowań omawianych zagadnień. Między innymi poświęcimy uwagę estymatorom największej wiarygodności i estymatorom uogólnionej metody momentów, a w szczególności estymatorom bayesowskim, gdzie omówimy ich tzw. mocne uporządkowanie rozpatrując różne postacie funkcji straty. Pokażemy, że dobierając w odpowiedni sposób rozkłady a priori i funkcje straty oraz bazując na znanych twierdzeniach o zachowaniu porządków stochastycznych możemy w rezultacie otrzymywać pewne ciekawe nierówności, np. na oszacowanie ogona dystrybuanty rozkładu normalnego.