

Testy jednostajnie najmocniejsze

Streszczenie

Niech P_0 będzie miarą probabilistyczną na $(\mathcal{X}, \mathcal{B})$. Dla ciągu π_n mierzalnych partycji zbioru \mathcal{X} rozważmy ciąg hipotez alternatywnych określonych przez ciąg zbiorów alternatyw $\{P : \sum_{A \in \pi_n} |P(A) - P_0(A)| > \delta\}$, $\delta > 0$. Dowodzi się, że jeśli tzw. efektywna licznosc partycji jest rzędu co najwyżej $O(n)$, to istnieje ciąg testów o jednostajnie wykładniczo znikających prawdopodobieństwach błędów I i II rodzaju. Natomiast jeśli licznosc partycji jest wyższego rzędu, to nie istnieje ciąg testów o tej własności.

Literatura

- [1] Barron, A. R. (1989) Uniformly powerful goodness of fit tests. *Ann. Statist.*, **17**, 107–124.