

Detekcja stochastycznego porządku

Streszczenie

Referat oparty będzie na najnowszej pracy T. Ledwiny i G. Wyłupka, ukończonej miesiąc temu. Rozważa się dwie niezależne próby o ciągłych dystrybuantach F i G . Celem pracy jest konstrukcja czułych testów dla weryfikowania hipotezy $F \geq G$. Hipoteza ta jest też nazywana stochastyczną dominacją. W ostatnich latach ukazało się wiele prac, szczególnie w literaturze ekonometrycznej, proponujących różne rozwiązania tego problemu. Omówimy pokrótce istniejące rozwiązania i pokażemy dwa nowe. Przedstawimy wyniki symulacyjnego porównania nowych testów z istniejącymi. Przedyskutujemy też wyniki teoretyczne dotyczące własności nowych testów.