

Wielowymiarowe funkcje kwantylowe i wielowymiarowe porządki stochastyczne

Streszczenie

W drugiej części referatu przedstawione zostaną związki między wielowymiarowymi funkcjami kwantylowymi zaprezentowanymi w części pierwszej i wielowymiarowymi porządkami: ortantowymi, stochastycznym, hazardowym i odwrotnym hazardowym. W miarę możliwości zostanie też omówiony związek funkcji kwantylowych z porządkiem ilorazu wiarygodności.

Wielowymiarowe rozkłady prawdopodobieństwa bywają często zadawane poprzez funkcje łącznikowe (ang. ‘copula’), w szczególności przez archimedesowe funkcje łącznikowe. Jako ilustracja wcześniej poznanych związków zostaną przedstawione wyniki dotyczące uporządkowania funkcji łącznikowych. Wyniki te są znane (np. Roger Nelsen, *An Introduction To Copulas*), jednak wielowymiarowe funkcje kwantylowe pozwalają na bardziej intuicyjne ich sformułowanie.