

dr Agnieszka Kulawik

Uniwersytet Śląski w Katowicach, Instytut Matematyki

dr hab. Stefan Zontek, prof. UZ

Uniwersytet Zielonogórski, Wydział Matematyki, Informatyki i Ekonometrii

Adaptacyjny poziom ucinania w estymacji i jego zastosowanie

W referacie przedstawiony zostanie adaptacyjny wybór poziomu ucinania dla estymatora Hubera [1] w modelu normalnym z parametrem przesunięcia i ze znaną wariancją. Metoda ta polega na wykorzystaniu estymatora największej wiarygodności w pewnym nowym modelu. W trakcie referatu omówione zostaną zarówno najważniejsze własności nowego modelu, jak również wyniki symulacji komputerowych.

Bibliografia

- [1] P. J. Huber, *Robust Statistics*, Wiley, New York, 1981.