

dr hab. Marek Męczarski, prof. SGH
Szkoła Główna Handlowa w Warszawie, Instytut Ekonometrii

O estymacji współczynnika dopasowania w statystyce aktuarialnej

Referat zawiera przegląd metod estymacji ważnego dla problematyki aktuarialnej współczynnika dopasowania, parametru będącego elementem oszacowań prawdopodobieństwa ruiny. Wyniki nie są nowe (ostatnie dekady XX w.), ale dość mało spopularyzowane i rzadko omawiane w podręcznikach.