

Piotr Nowak

Instytut Matematyczny Uniwersytetu Wrocławskiego

E-mail: nowak@math.uni.wroc.pl

Uporządkowanie stochastyczne estymatorów metody momentów parametrów rozkładu gamma

Idea stochastycznego porównywania estymatorów jest często spotykana w literaturze, np. [1], [2], [3], [4]. Wymienione prace omawiają przede wszystkim uporządkowanie stochastyczne estymatorów metody największej wiarygodności. W komunikacie zostaną zaprezentowane analogiczne wyniki uzyskane dla estymatorów metody momentów, w szczególności dla estymatorów parametrów skali i kształtu rozkładu gamma. Zostaną podane także przykłady uporządkowań wspomnianych estymatorów względem innych znanych porządków stochastycznych oraz zastosowania do porównywania przedziałów ufności.

Bibliografia

- [1] N. Balakrishnan, C. Brain, J. Mi, *Stochastic order and MLE of the mean of the exponential distribution*, Methodology and Computing in Applied Probability 4 (2002), 83–93.
- [2] N. Balakrishnan, G. Iliopoulos, *Stochastic monotonicity of the MLE of exponential mean under different censoring schemes*, Annals of the Institute of Statistical Mathematics 61 (2009), 753–772.
- [3] N. Balakrishnan, J. Mi, *Order-preserving property of maximum likelihood estimator*, Journal of Statistical Planning and Inference 98 (2001), 88–99.
- [4] G. Gan, *MLE are stochastically increasing if likelihood are unimodal*, Statistics & Probability Letters 40 (1998), 289–292.