

*prof. dr hab. Ryszard Zieliński*  
*IMPAN Warszawa*

## **Estymacja wysokich kwantyli**

W zastosowaniach (ekonomia, finanse, VaR, ekologia) pojawia się problem oszacowania kwantyli wysokiego rzędu, np. kwantyla rzędu 0.99 lub nawet 0.999. Dla danego zjawiska taki kwantyl interpretowany jest jako próg, który może być przekroczony z małym prawdopodobieństwem, np. 0.01 lub 0.001. Cała informacja z obserwacji, którymi dysponujemy, zawarta jest w dystrybucji empirycznej, która jest funkcją schodkową, równą jeden na prawo od największej wartości w próbie. Typowe metody estymacji wysokich kwantyli polegają na ekstrapolacji danych poza zakres obserwacji, ale wybór funkcji ekstrapolującej nastęrcza trudności. W odczycie przedstawię pewne inne podejście do tego zagadnienia.