

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

O estymacji współczynnika dopasowania za pomocą procedury Robbinsa–Monro

Referat dotyczy metody estymacji ważnego dla statystyki aktuarialnej współczynnika dopasowania opartej na procedurze Robbinsa–Monro. Proponuje się modyfikację oryginalnej metody U. Herkenratha (1986), poprawiającą wariancję asymptotyczną estymatora.