

Wykład 12 ze statystyki matematycznej (26.05.25)

1. Konstrukcja elipsoidalnych zbiorów ufności dla wektora średnich w przypadku próby prostej z $N_s(m, \Sigma)$ ze znaną macierzą kowariancji, z estymowaną macierzą kowariancji, a także dla próby prostej z dowolnego niezdegenerowanego rozkładu o skończonych momentach rzędu 2.
2. Estymatory asymptotycznie normalne, asymptotyczna nierówność typu Craméra-Rao dla estymatorów asymptotycznie normalnych, program Fishera, asymptotyczna efektywność, estymatory superefektywne.
3. Lemat: Jeżeli macierze A i B są dodatnio określone i $A - B$ jest nieujemnie określona, to $B^{-1} - A^{-1}$ jest nieujemnie określona.
4. Interpretacja efektywności asymptotycznej w terminach najmniejszych elipsoidalnych zbiorów ufności dla estymowanego wektora parametrów.