

## Temat 24

Niech  $X_1, \dots, X_n$  będzie próbą prostą z nieznanego rozkładu wykładniczego  $Exp(\lambda)$ . Rozważmy dwa estymatory dystrybuanty: estymator największej wiarygodności oraz dystrybuantę empiryczną. Dla  $n = 50, \lambda = 2$  wygenerować obserwacje i obliczyć dokładnie (ze wzoru a nie numerycznie) błąd estymacji obu estymatorów w normie supremum. Powtórzyć eksperyment MC=100 razy i przetestować na poziomie istotności  $\alpha = 0.05$  hipotezy o stochastycznej dominacji (w obie strony) jednego błędu nad drugim.