

Název předmětu: Neparametrické a robustní metody KMI/NARM

Počet kreditů: 5

Hodinová dotace: 2/1

Návaznost předmětu: Úvod do teorie pravděpodobnosti

Anotace:

Neparametrické a robustní odhady parametrů polohy a měřítka. Neparametrické testy parametrů polohy a měřítka.

Cíl:

Předmět je povinně volitelným předmětem magisterského stupně studia všech studijních programů. Rozšiřují instrumentarium odhadů a testů přednášených v předmětu Úvod do teorie pravděpodobnosti. Současně reaguje na skutečnost, že robustní a neparametrické metody se při hodnocení reálných dat využívají stále častěji, neboť nebývají splněny poměrně přísné požadavky parametrických testů.

Osnova:

- Pořádkové statistiky a jejich rozdělení;
- některé testy a odhady na základě pořádkových statistik;
- pořadové statistiky;
- neparametrické testy parametru polohy;
- neparametrické testy v rozdílu v poloze dvou výběrů;
- neparametrické testy rozdílu v měřítku;
- neparametrické testy nezávislosti;
- neparametrické odhady parametru polohy a relativní četnosti;
- vybrané robustní odhady parametru polohy;
- vybrané robustní odhady parametru měřítka.