

SPIS TREŚCI

Wprowadzenie	7
1. Statystyki pozycyjne i ich własności	13
1.1. Uwagi wstępne	13
1.2. Podstawowe statystyki pozycyjne	13
1.3. Charakterystyki liczbowe i funkcyjne statystyk pozycyjnych	19
1.4. Graniczne rozkłady statystyk pozycyjnych	33
1.5. Uwagi końcowe	55
2. Metody estymacji oparte na statystykach pozycyjnych	57
2.1. Uwagi wstępne	57
2.2. Metoda kwantyli	58
2.3. Kwantylowa metoda najmniejszych kwadratów	68
2.4. Modyfikacje kwantylowej metody najmniejszych kwadratów	69
2.4.1. Kwantylowa metoda najmniejszych kwadratów z uciętą liczbą kwantyli	70
2.4.2. Medianowo-kwantylowa metoda najmniejszych kwadratów	74
2.5. Metoda momentów ważonych prawdopodobieństwami	75
2.6. Zmodyfikowana metoda momentów ważonych prawdopodobieństwami	84
2.7. Bayesowskie metody estymacji	89
2.8. Bootstrapowe metody estymacji	93
2.9. Uwagi końcowe	98
3. Analiza własności opartych na statystykach pozycyjnych estymatorów parametrów wybranych rozkładów	99
3.1. Uwagi wstępne	99
3.2. Badania własności estymatorów otrzymanych metodą kwantyli	100
3.3. Symulacyjne badania własności estymatorów otrzymanych kwantylową metodą najmniejszych kwadratów z uciętą liczbą kwantyli	120
3.4. Symulacyjne badania własności estymatorów uzyskanych medianowo-kwantylową metodą najmniejszych kwadratów	132
3.5. Symulacyjne badania własności estymatorów otrzymanych metodami momentów ważonych prawdopodobieństwami	133
3.6. Analiza porównawcza własności wybranych estymatorów	138
3.7. Zastosowanie procedur estymacji opartych na statystykach pozycyjnych w badaniach ekonomicznych	143
3.8. Uwagi końcowe	144

4. Procedury estymacji parametrów pozycyjnych zmiennej losowej i ich zastosowania....	147
4.1. Uwagi wstępne	147
4.2. Estymatory kwantyli	148
4.3. Klasyczne metody wyznaczania przedziałów ufności dla kwantyli	156
4.4. Bayesowska estymacja kwantyli	163
4.5. Bootstrapowe procedury estymacji kwantyli.....	168
4.6. Estymacja dominanty	173
4.7. Przykłady zastosowań estymatorów parametrów pozycyjnych.....	178
4.7.1. Szacowanie miar ubóstwa i bogactwa w analizach dochodów ludności	178
4.7.2. Estymacja miar ryzyka rynkowego	184
4.7.3. Konstrukcja kart kontrolnych z wykorzystaniem estymatorów mediany	192
4.8. Uwagi końcowe.....	195
5. Statystyki pozycyjne w analizach zdarzeń ekstremalnych	197
5.1. Uwagi wstępne	197
5.2. Estymacja parametrów uogólnionych rozkładów statystyk ekstremalnych.....	198
5.3. Semiparametryczne metody szacowania indeksu ekstremalnego.....	201
5.4. Estymacja ogona rozkładu zmiennej losowej i jej zastosowanie	207
5.5. Bootstrapowa estymacja kwantyli wykorzystująca oszacowanie ogona rozkładu zmiennej losowej.....	216
5.6. Zastosowanie statystyk ekstremalnych w wybranych procedurach estymacji.....	219
5.6.1. Szacowanie ryzyka ekstremalnego.....	219
5.6.2. Konstrukcja kart kontrolnych w oparciu o statystyki ekstremalne.....	223
5.7. Uwagi końcowe.....	226
6. Wybrane empiryczne zastosowania statystyk pozycyjnych w badaniach ekonomicznych ...	227
6.1. Uwagi wstępne	227
6.2. Zastosowanie statystyk pozycyjnych w analizach dochodów i wydatków ludności.....	228
6.3. Zastosowanie kwantyli z próby do estymacji miar ryzyka na rynku finansowym.....	234
6.4. Zastosowanie metod estymacji opartych na statystykach pozycyjnych na rynku ubezpieczeniowym.....	242
6.5. Wykorzystanie statystyk pozycyjnych w ocenie działalności przedsiębiorstw	248
6.6. Uwagi końcowe.....	251
Zakończenie	253
Order statistics in estimation procedures and their applications in economic research (Summary)	259
Aneks. Charakterystyki funkcyjne i liczbowe wybranych rozkładów	263
Wybrane oznaczenia	275
Literatura.....	279
Od Redakcji.....	287