O estymacji parametrów wielowymiarowych rozkładów α–stabilnych subgaussowskich

Piotr Szymański

Instytut Informatyki Stosowanej
Wyższa Szkoła Gospodarki w Bydgoszczy
e-mail: piotr.szymanski@byd.pl

Rozkłady subgaussowskie α–stabilne stanowią ważną, z punktu widzenia zastosowań, podklasą wielowymiarowych rozkładów α–stabilnych. W trakcie prezentacji pokazany zostanie dwukrokowy estymator parametrów tego typu rozkładów oparty o metody momentów i największej wiarygodności.