

Е.Е. Пролиско

Брест, БрГУ имени А.С. Пушкина

РОБАСТНЫЕ СВОЙСТВА БУТСТРАП-ОЦЕНОК

Бутстрап-метод является одним из наиболее современных и перспективных статистических методов оценки инференции выборочных данных. В современной литературе практически не описываются робастные свойства бутстрап-оценок, т.е. их реакцию на наличие в основной выборке данных из других генеральных совокупностей или ошибочно измеренных данных. Проведено исследование устойчивости бутстрап-оценок с различными типами распределений как основной так и «загрязняющей» выборки. В основе исследования лежит применение метода имитационного моделирования, который сравнивается с оценками устойчивости полученными классическими методами.