

DOKTORANTŪROS STUDIJŲ DALYKO APRAŠAS

Dalyko pavadinimas	Mokslo kryptis (šaka) kodas	Fakultetas	Katedra
Asimptotinė statistika	Matematika 01P	Matematikos ir informatikos	Ekonometrinės analizės, Matematinės statistikos
Studijų būdas	Kreditų skaičius	Studijų būdas	Kreditų skaičius
Paskaitos	0	Konsultacijos	1
Individualus	4	Seminarai	0

Dalyko anotacija
Stochastinis konvergavimas: bazinė teorija, stochastiniai o ir O simboliai, momentų konvergavimas, delta metodas. M ir Z įvertiniai: pagrįstumas, asimptotinis normalumas, maksimalaus tikėtimumo įvertiniai. Kontigualumas. Lokalus asimptotinis normalumas: tikėtimumo funkcijos skleidinys, konvergavimas į normalų eksperimentą, skirstinys alternatyvos atžvilgiu, lokalus asimptotinis normalumas. Įvertinių efektyvumas: apatiniai režiai rizikai, teorema apie sąsūką, lokaliai asimptotiškai minimaksiniai įvertiniai.
Pagrindinė literatūra
1. A. W. van der Vaart. <i>Asymptotic Statistics</i> . Cambridge University Press, 1998.
2. Juan Shao. <i>Mathematical Statistics</i> . Springer, New York, 1998.

Konsultuojančiųjų dėstytojų vardas, pavardė	Mokslo laipsnis	Pedag. vardas	Svarbiausieji darbai mokslo kryptyje (šakoje) paskelbti per pastaruosius 5 metus
Vytautas Kazakevičius	Dr.	Doc.	<ol style="list-style-type: none"> Kazakevičius, Vytautas. Feller chains and random functions = Felerio grandinės ir atsitiktinės funkcijos // Lietuvos matematikos rinkinys. LMD darbai. Ser. A. Vilnius: Matematikos ir informatikos institutas. ISSN: 0132-2818. 2015, T. 56, p. 48-53. Kazakevičius, Vytautas. On ergodicity of general Markov chains // Lithuanian mathematical journal. New York: Springer. ISSN: 0363-1672. 2014, Vol. 54, no. 4, p. 429-446. Kazakevičius, Vytautas. Limits of the Letac principle. The discrete case // Lithuanian mathematical journal. New York: Springer. ISSN: 0363-1672. 2012, vol. 52, no. 4, p. 390-399.
Alfredas Račkauskas	Habil. dr.	Prof.	<ol style="list-style-type: none"> Račkauskas, Alfredas; Suquest, Charles, Functional Laws of Large Numbers in Holder Spaces. // ALEA-LATIN AMERICAN JOURNAL OF PROBABILITY AND MATHEMATICAL STATISTICS. Volume: 10 Issue: 2 Pages: 609-624 Published: 2013 Characiejus, Vaidotas; Račkauskas, Alfredas, Operator self-similar processes and functional central limit theorems., // STOCHASTIC PROCESSES AND THEIR APPLICATIONS. Volume: 124 Issue: 8 Pages: 2605-2627 Published: AUG 2014. Markevičiūtė, Jurgita; Račkauskas, Alfredas; Suquet, Charles, Testing the epidemic change in nearly nonstationary autoregressive processes. // NONLINEAR ANALYSIS-MODELLING AND CONTROL. Volume: 19 Issue: 1 Pages: 67-82 Published: 2014 Characiejus, Vaidotas; Račkauskas, Alfredas, Weak law of large numbers for linear processes, Acta Math. Hungar., 149 (1) (2016), 215–232. Alfredas Račkauskas and Charles Suquet Computing the distribution of sequential Hölder norms of the Brownian motion, COMMUNICATIONS IN STATISTICS—THEORY AND METHODS 2016, VOL. 45, NO. 15, 4378–4391.

Patvirtinta Matematikos ir informatikos fakulteto taryboje 2017 m. kovo 14 d., protokolo Nr. 5

Fakulteto tarybos pirmininkas prof. habil. dr. Mindaugas Bloznelis