

Секция «Математика и механика»

О точности аппроксимации статистик в многомерном случае

Липатьев Александр Андреевич

Аспирант

*Московский государственный университет имени М.В. Ломоносова, Факультет
вычислительной математики и кибернетики, Королёв, Россия*

E-mail: aborigen26@mail.ru

- Проблемы, приводящие к тестированию гипотез в многомерном случае.
- Статистики, используемые в многомерном случае, и их асимптотические распределения — Wilks' Lambda, Lawley-Hotelling, Pillai.
- Точность аппроксимации статистики Pillai.

Литература

1. Anderson T.W., An Introduction to Multivariate Analysis, third ed., Wiley, New York, 2003.
2. Fujikoshi Y., Ulyanov V. V. Error bounds for asymptotic expansions of Wilks' lambda distribution // Journal of Multivariate Analysis, 2006, No. 7, p. 1941 - 1957.
3. Fujikoshi Y., Ulyanov V. V., Shimizu R. Multivariate statistics. High dimensional and large-sample approximations, Wiley Series in Probability and Statistics. Hoboken, NJ: John Wiley & Sons, 2010.