

Procjena repne zavisnosti metodom momenata

Neka je $(X_1, Y_1), \dots, (X_n, Y_n)$ niz nezavisnih slučajnih vektora sa zajedničkom, neprekidnom funkcijom distribucije F . Ako vektor normaliziranih koordinatnih maksimuma tog slučajnog uzorka konvergira po distribuciji prema slučajnom vektoru sa funkcijom distribucije G , i G ima nedegenerirane marginalne distribucije, kažemo da je F u domeni privlačnosti od G . Pod pretpostavkom da kopula distribucije G pripada nekoj parametarskoj familiji, definiramo procjenitelja repne zavisnosti od F metodom momenata.

U izlaganju ću predstaviti osnovne ideje višedimenzionalne teorije ekstremnih vrijednosti, definirati procjenitelja funkcije repne zavisnosti, opisati njegova asimptotska svojstva te ilustrirati ponašanje procjenitelja na primjerima.