

Многомерный статистический анализ

Хаткевич Людмила Анатольевна

4 декабря 2013 г.

Вопросы

1. Плотность $\mathcal{N}(\mu, \Sigma)$.
2. Независимые векторы.
3. Некоррелированные векторы.
4. Ковариационная матрица.
5. Маргинальное распределение.
6. Эллипсоид рассеяния.
7. Выборочная ковариационная матрица.
8. Асимптотическая нормальность.
9. Коэффициент корреляции.
10. Выборочный коэффициент корреляции.
11. Условный коэффициент корреляции.
12. Выборочный условный коэффициент корреляции.
13. Множественный коэффициент корреляции.
14. Свойства коэффициента корреляции.
15. Свойства множественного коэффициента корреляции.
16. Критерий проверки гипотезы об условной независимости.
17. Критерий проверки гипотезы о независимости от множества.
18. ОМП-оценка.
19. Уровень значимости критерия.
20. Мощность критерия.
21. Критерия отношения правдоподобия.
22. Функция правдоподобия. Где используется.
23. Распределение Стьюдента.
24. Распределение Фишера.
25. Распределение Уиперта.
26. Проверка гипотез
 - (а) о независимости
 - (b) об условн.
 - (с) о независимости от множества.
27. Распределение линейного преобразования нормальной выборки.

28. Маргинальное распределение.
29. Распределение ОМП-оценок.
30. Распределение выборочного парного коэффициента корреляции.
31. Распределение выборочного множественного коэффициента корреляции.
32. Распределение выборочного условного коэффициента корреляции.