

Probny dokument L^AT_EX

9 maja 2017

Przez asymptotyczną zgodność estymatora w niniejszej pracy rozumie się klasyczne pojęcie zgodności estymatora. Niech $\underline{\mathbf{X}}_1^n = (\underline{X}_1, \underline{X}_2, \dots, \underline{X}_n)$ będzie procesem *iid* n zmiennych losowych, estymator $\hat{\boldsymbol{\theta}}_n = \hat{\boldsymbol{\theta}}(\underline{\mathbf{X}}_1^n)$ rozważany jako proces losowy $(\hat{\boldsymbol{\theta}}_1, \dots, \hat{\boldsymbol{\theta}}_n)$ jest asymptotycznie zgodnym estymatorem parametru $\boldsymbol{\theta}$, wtedy i tylko wtedy, gdy $\text{plim}_{n \rightarrow \infty} \hat{\boldsymbol{\theta}}_n = \boldsymbol{\theta}$ (proces $\hat{\boldsymbol{\theta}}_n$ jest zbieżny według prawdopodobieństwa do wartości parametru $\boldsymbol{\theta}$).