

dr hab. Marek Męczarski, prof. SGH
Szkoła Główna Handlowa w Warszawie, Instytut Ekonometrii

O nieparametrycznych metodach bayesowskich

Nieparametryczne podejście do statystycznej analizy bayesowskiej jest jednym ze sposobów radzenia sobie z problemem wyboru rozkładu *a priori*. W odróżnieniu od parametrycznego bayesowskiego modelu statystycznego, w miejsce rozkładu *a priori* na skończeniowym wymiarowej przestrzeni wartości parametru indeksującego rodzinę rozkładów próby określa się rozkład *a priori* na tej rodzinie rozkładów. Metody są zaawansowane i odwołują się zarówno do ogólnej teorii procesów stochastycznych, jak i do ich szczególnych rodzajów. Tym niemniej istnieje już bardzo wiele zastosowań nieparametrycznej bayesowskiej analizy statystycznej.

Literatura

- [1] T. Ferguson, *A Bayesian analysis of some nonparametric problems*, Annals of Statistics 1 (1973), 209–230.
- [2] J. K. Ghosh, R. V. Ramamoorthi, *Bayesian Nonparametrics*. Springer Verlag, New York 2003.
- [3] M. Męczarski, *On basic notions of nonparametric Bayesian inference*, Statistics in Transition – new series 8 (2007), 577–591.
- [4] W. Niemirow, *Bayesian prediction with an asymmetric criterion in a nonparametric model of insurance risk*, Statistics 40 (2006), 353–363.