

Hauptseminar
„Nichtparametrische Statistik“
WS 2012/2013
Mo 16 – 18 Uhr
05-136
Beginn: 29.10.2012

Thema des Hauptseminars ist das Schätzen der unbekanntes Dichte einer reellwertigen Zufallsvariablen nach Beobachtung einer großen Zahl n von iid Realisationen, oder das Schätzen einer unbekanntes Regressorfunktion. Dabei handelt es sich um ein nichtparametrisches Problem, und es ergeben sich langsamere Konvergenzraten als in parametrischen Problemen. Optimale Raten hängen von den Glattheitseigenschaften der als Modell zugrunde gelegten Funktionsklassen (Hölder, Sobolev, ...) ab.

Literatur: Tsybakov, Introduction to Nonparametric Estimation, Springer 2009.

Vorkenntnisse: Stochastik I. Spezielle Statistik-Kenntnisse keine Vorbedingung.

gez. R. Höpfner



E-Mail: hoepfner@mathematik.uni-mainz.de
Internet: <http://www.mathematik.uni-mainz.de/~hoepfner>
Dienstgebäude: Staudingerweg 9 (Bau 2 413), Raum 05-621