

Kompaktkurs

Foundations and applications of modern nonparametric statistics

Professor Dr. Wolfgang Härdle (Humboldt-Universität zu Berlin)

Professor Dr. Vladimir Spokoiny (Weierstraß-Institut für Angewandte Analysis und Stochastik, Berlin)

Termin: 15./16. Mai 2008

Ort: Fraunhofer Institut für Techno- und Wirtschaftsmathematik (ITWM)
Fraunhoferplatz 1, 67663 Kaiserslautern

Anreiseplan: www.itwm.fhg.de

vom Bahnhof zu Fuß (10-15 min): den Bahnhof über den Südausgang (d.h. nicht durch die Bahnhofshalle) verlassen, nach rechts wenden und immer geradeaus

Donnerstag, 15.5.2008

9:00 - 12:15 Parametric maximum likelihood estimation

- maximum likelihood. examples
- exponential family
- exponential bound for (quasi) likelihood
- corollaries: confidence sets, risk bounds, tests

14:00 - 17:15 The local parametric approach

- regression models
- localization and local parametric assumption
- "small modeling bias" condition
- "oracle" choice of localizing scheme

Freitag, 16.5.2008

9:00 - 12:15 Adaptive local parametric estimation with applications to risk management

- local model selection procedure
- "oracle" risk bounds
- applications to risk management

Anmeldung:

Für unsere Planung melden Sie sich bitte bis zum 12.5. bei Dr. Claudia Kirch (ckirch@mathematik.uni-kl.de) per email mit dem Betreff „Kompaktkurs“ an.