

SZEMINÁRIUM

Az ELTE TTK Valószínűségelméleti és Statisztika Tanszékének
szemináriumán 2013. május 3-án, pénteken 10 órakor

Fegyverneki Tamás (ELTE TTK Valószínűségelméleti és Statisztika
Tanszék)

Távolságkorreláció

címmel, továbbá 2013. május 10-én, pénteken 10 órakor

T. Szabó Tamás (Szegedi Tudományegyetem Bolyai Intézet)

Változásészlelés bizonyos diszkrét és folytonos idejű elágazó folyamatokra,

címmel, majd 2013. május 10-én, pénteken 11 órakor

Körmendi Kristóf (Szegedi Tudományegyetem Bolyai Intézet)

Paraméterbecslés többtípusos Galton-Watson folyamatokban

címmel tart előadást.

Az előadások helye: ELTE lágymányosi campus, déli épület (1117
Budapest, Pázmány Péter s.1/A), 3-316.

Kivonatok:

Az előadáson az egészértékű autoregressziós folyamatokra kidolgozott változásészlelési technikákat és bizonyítási módszereket alkalmazzuk, hogy hasonló eredményeket érjünk el a Cox–Ingersoll–Ross-folyamatra és egy Heston-típusú modellre az ergodikus esetben.

Az előadáson a kéttípusos Galton-Watson folyamat utóeloszlásának várható érték mátrixát becsüljük a kritikus, duplán szimmetrikus esetben, majd megvizsgáljuk ezen becslések aszimptotikus tulajdonságait.