



Universität Augsburg
Institut für Mathematik



TopMath-Seminar

Herr Andreas Käufl

Universität Augsburg

spricht am

Donnerstag, 16. Juni 2011

um

15:45 Uhr

im

Raum 1009 (L1)

über das Thema:

**»Maximum-Likelihood-Schätzung in
graphischen Normalverteilungsmodellen«**

Abstract:

Ein wichtiges Ziel der multivariaten Statistik ist es, die Wechselwirkungen zwischen den an einem Datensatz beteiligten Variablen zu verstehen. Als nützliches Hilfsmittel haben sich hierbei die graphischen Modelle herausgestellt. Liegt zusätzlich eine Normalverteilungsannahme zugrunde, so sind die Maximum-Likelihood-Schätzer des Mittelwert- und des Streuungsparameters seit Längerem bekannt. Unbekannt war lange Zeit allerdings die Verteilung des Kovarianzschätzers, erst 2010 konnte dessen Lebesgue-Dichte von Andersson und Klein bestimmt werden. Im Vortrag soll veranschaulicht werden, wie diese sogenannte verallgemeinerte Wishart-Verteilung aussieht und wo sie im Zusammenhang mit graphischen Normalverteilungsmodellen auftritt.

Hierzu ergeht herzliche Einladung.
