

SZEMINÁRIUM

Az ELTE TTK Valószínűségelméleti és Statisztika Tanszékének
szemináriumán 2014. október 17-én, pénteken 10 óra 30 perckor

Sikolya Kinga (Debreceni Egyetem)

*Ornstein–Uhlenbeck-mező előrejelzésére vonatkozó optimális mintavételi terv
meghatározása*

címmel tart előadást.

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

Kivonat: Érdekes és számos helyen alkalmazható probléma különböző kritériumok szerinti optimális mintavételi elhelyezések meghatározása bizonyos modellek esetén. Ornstein–Uhlenbeck-mező esetén vizsgáltuk a paraméterbecslés szerinti optimális mintavételt a mintapontok két speciális elrendezését tekintve. Továbbá Ornstein–Uhlenbeck-mező esetén sikerült eredményeket elérni az optimális előrejelzés témakörében is. A kapott elméleti eredményeket numerikus számításokkal támasztottuk alá. Az eredmények Baran Sándorral és Milan Stehlíkkal közösek.