

## SZEMINÁRIUM

Az ELTE TTK Valószínűségelméleti és Statisztika Tanszékének  
szemináriumán 2013. november 8-én, pénteken 10 órakor

Mánfay Máté (MTA SZTAKI)

*Lévy-folyamatokkal hajtott véges dimenziós lineáris rendszerek  
identifikációja*

címmel tart előadást.

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

---

Kivonat:

Lévy-folyamatokkal való modellezés gyakori a pénzügyi matematikában, telekommunikációban, közgazdaságtanban és a természettudományokban. Az előadáson Lévy-folyamatok növekményeivel meghajtott véges dimenziós lineáris rendszerek identifikációját tárgyaljuk. Célunk mind a rendszer, mind a meghajtó folyamat paramétereinek becslése. A probléma érdekessége abban rejlik, hogy a meghajtó zaj nem a sűrűségfüggvényével, hanem a karakterisztikus függvényével van megadva. A maximum likelihood módszer alternatívájaként az empirikus karakterisztikus függvény módszer lineáris rendszerekre való adaptálásával dolgozzuk ki a paraméterek becslését.