



МИНИКУРС ЛАБОРАТОРИИ ИМ. ЧЕБЫШЕВА

Алексей Мин (Технический университет, Мюнхен)



«Статистическое моделирование с помощью копул»

Лаборатория Чебышева, ауд. 413, 14-я линия В.О., 29

Расписание лекций:

пн. 3 сентября 17:10—18:45, вт. 4 сентября 17:10—18:45

пн. 10 сентября 17:10—18:45, вт. 11 сентября 17:10—18:45

Настоящий курс посвящен моделированию многомерных данных с помощью копул и, в особенности, с помощью вайн-копул (vine copula). Сперва будут введены копулы и меры конкорданса, а также представлена теорема Шкляра. Затем будут рассмотрены архимедовы и эллиптические копулы совместно с их свойствами. Также будет обсуждено параметрическое и непараметрическое оценивание копул. В настоящий момент вайн-копулы являются одним из самых многообразных классов построений многомерных копул, которые будут представлены и классифицированы. Оценивание и выбор моделей для вайн-копул завершит курс. Настоящий курс будет сопровождаться практическими сессиями, где слушатели будут работать с R пакетами CDVine и VineCopula. В практических сессиях слушатели научатся симулировать многомерные данные, оценивать и выбирать модели вайн-копул. Этот курс предполагает, что слушатели имеют лишь самые начальные сведения по теории вероятностей и математической статистике.

Приглашаются все желающие!