Einladung zum

Würzburger Mathematischen Kolloquium

Julius-Maximilians-Universität Würzburg • Fakultät für Mathematik und Informatik

Simone Padoan

Universitá Bocconi, Milano, Italien

Multivariate Extreme-Value Theory and Estimation

Mittwoch, 5. Dec. 2018 • 16:15 Uhr

Raum SE 40, Mathematik Ost, Emil-Fischer-Str. 40, Campus Hubland-Nord

Inhaltsangabe:

Many applications in risk analysis require the estimation of the dependence among multivariate maxima, especially in environmental sciences. Such dependence can be described by the Pickands dependence function of the underlying extreme-value copula. A nonparametric estimator is constructed as the sample equivalent of a multivariate extension of the madogram function. We discuss the The large-sample theory of the estimator and we show its finite-sample performance with a simulation study.

Zu diesem Vortrag laden wir Sie herzlich ein.
Im Anschluss an den Vortrag stehen Tee und Kaffee im Foyer vor dem SE 40 bereit.

Die Dozentinnen und Dozenten der Mathematik