

## Kolloquium über Mathematische Statistik und Stochastische Prozesse

—  
Andreas Andresen  
Weierstraß-Institut für Angewandte Analysis und  
Stochastik, Berlin

22.04.2014, 16:15 Uhr, Geom H5

„Analyse von Maximal Likelihood Schätzern  
unter endlichen Stichproben“

Abstract: "In semiparametrische Schätzproblemen ist das volle Modell unendlichdimensional, während der interessierende Parameter von endlicher meist geringer Dimension ist. Erstaunlicherweise lassen sich auch in solchen Fällen parametrische Raten erzielen. Zentral sind in diesem Zusammenhang das Wilks Phänomen, welches besagt, dass der semiparametrische loglikelihood Quotient asymptotisch Chi -quadrat verteilt ist, wobei die Anzahl der Freiheitsgrade alleine durch die Dimension des Zielparameters bestimmt ist. Der Vortrag stellt eine neue Methode vor, mittels derer diese Resultate auf falsch spezifizierte Modelle mit endlichen Stichproben übertragen werden können."

Andreas Andresen  
Weierstraß-Institut (WIAS), Berlin  
Forschungsgruppe Stochastische Algorithmen und Nichtparametrische Statistik

Kontakt:

Prof. Dr. Natalie Neumeyer, Fachbereich Mathematik, Universität Hamburg  
[natalie.neumeyer@math.uni-hamburg.de](mailto:natalie.neumeyer@math.uni-hamburg.de)