



Kolloquium über Mathematische Statistik und Stochastische Prozesse

Dr. Stanislav Volgushev, Ruhr-Universität Bochum

11.06.2013, 16:15 Uhr, Raum H5

Modellwahl für zensierte Quantilsregression

Zensierte Daten tauchen in vielen wichtigen Bereichen wie zum Beispiel der Überlebenszeitanalyse auf. In den letzten Jahren wurde gezeigt, dass Quantilsregression eine elegante Methode bietet, solche Daten zu analysieren. Eine wichtige und bislang offene Frage bei zensierter Quantilsregression ist die der Modellwahl. Im Rahmen des Vortrages wird eine auf Penalisationen basierende Lösung für diese Frage vorgestellt und die asymptotischen Eigenschaften dieser Methode werden hergeleitet. Insbesondere zeigen wir, dass die direkte Übertragung klassischer Ansätze wie adaptive LASSO oder SCAD zu Schätzern mit nicht optimalen Raten führen können.

Dr. Stanislav Volgushev
Ruhr-Universität Bochum
Fakultät für Mathematik
Lehrstuhl für Stochastik
44780 Bochum
stanislav.volgushev@ruhr-uni-bochum.de

Kontakt: Prof. Dr. Natalie Neumeier, Universität Hamburg, natalie.neumeier@math.uni-hamburg.de