

Otto-von-Guericke-Universität Magdeburg
Fakultät für Mathematik

Auf Einladung des Institutes für Mathematische Stochastik spricht

Frau Prof. Dr. Elisabeth Gassiat

(Université Paris Sud ORsay)

über das Thema

Inference in nonparametric hidden Markov models

Ort: Otto-von-Guericke-Universität, G18-401

Zeit: 21. November 2019, 14:00 Uhr

Zu diesem Vortrag sind alle Interessierten herzlich eingeladen.

Abstract:

Un abstract: I will present recent works on nonparametric hidden models: identifiability when the state space is finite without any prior information on the emission distributions and adaptive minimax estimation of model. I will also give results in the case of fully nonparametric modeling of hidden Markov models (that is with continuous state space) in the case of Markov chains perturbed by additive noise.