



Universität
Bremen



Wintersemester 22 / 23

Einladung zum ZeSOB Kolloquium

Am Montag, 19. Dezember 2022, ab 16.00h (s. t.) spricht Herr

Prof. Dr. Mathias Vetter

(Christian-Albrechts-Universität zu Kiel, Mathematisches Seminar)

über

On goodness-of-fit testing for point processes

Typical models for point processes like Hawkes processes or inhomogeneous Poisson processes are often of a parametric form where the intensity function or an additional self-exciting component is known up to an unspecified parameter. A lot of research since the seminal paper by Ogata (1978) has been devoted to the estimation of these unknown parameters but even in these rather standard models a consistent goodness-of-fit test has been missing. This talk aims to fill this gap. We will show how to formally set up a bootstrap procedure to allow for goodness-of-fit testing and we will discuss how to prove consistency of the test in the (already quite involved) case of an inhomogeneous Poisson process.

Der Vortrag findet statt am Montag, 19. Dezember 2022, ab 16.00 Uhr (s. t.) im Kompetenzzentrum für Klinische Studien (KKS) Bremen, Linzer Straße 4, 28359 Bremen, im Seminarraum im Erdgeschoss. Der Vortrag wird zusätzlich via ZOOM übertragen; die Zugangsdaten dafür werden rechtzeitig übersandt.

Alle Interessierten sind herzlich willkommen!

(Einladungsvorschlag von Prof. Dr. Thorsten Dickhaus)