

# POZVÁNKA na SEMINÁŘ

netradičně v pondělí 29. dubna v 13:15

v posluchárně č. 5.068 v budově PřF UPOL, 17. listopadu č. 12.

prof. Christian Genest

McGill University, Montreal, Kanada

a

prof. Johanna G. Nešlehová

McGill University, Montreal, Kanada & Wirtschaftsuniversität Wien, Rakousko

## Advances and Challenges in Hierarchical Copula Modeling for Large-Dimensional Data

**Abstrakt:** As copula modeling has proven to be a versatile tool in many contexts, the increasing availability of large-dimensional datasets calls for an ever richer pool of flexible yet feasible multivariate dependence structures. In this talk, we will first review various existing strategies to create copula models in large dimensions, including vines, factor copulas, or hierarchical Archimedean copulas. We will then highlight the role of stochastic representations and showcase their use in constructing alternative hierarchical models, such as risk aggregation models and hierarchical Archimax or Kendall copulas.

K účasti jsou zváni jak členové katedry, tak všichni učitelé, vědečtí pracovníci a studenti, kteří mají o problematiku zájem.

Aktuální program sledujte na [webových stránkách katedry](#),  
[Facebooku](#) či [Instagramu](#).

doc. RNDr. Jan Tomeček, Ph.D.  
vedoucí semináře

doc. RNDr. Jitka Machalová, Ph.D.  
vedoucí KMA

