

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. Johanna G. Nešlehová

McGill University, Montreal, Kanada & Wirtschaftsuniversität Wien, Rakousko

Finding a way through a correlation maze

Abstrakt: Pearson's correlation is a well-known way of quantifying dependence between random variables. Although ubiquitous, it has a number of pitfalls which limit its applicability in areas such as actuarial science and risk management where extreme outcomes are of particular interest. I will explain how copula modeling can come to the rescue and present Kendall's tau as an appealing alternative measure of correlation. Further study of Kendall's tau then invites two intriguing questions that I will tackle:

- (1) Does the knowledge of dependence between some variables in a system constrain the dependence between the remaining variables?
- (2) How can we make sense of messy large-scale Kendall correlation matrices?

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

