

Seminár **M7112 Mnohorozmerné statistické metódy I.** (ZS 2015/2016)

Mnohorozmerné normálne rozdelenie a jeho vlastnosti; pomocné tvrdenia z algebry; hlavné komponenty; kanonické korelácie; faktorová analýza; diskriminačná analýza, rozdelenie kvadratických foriem, Wishartovo rozdelenie

Literatúra:

Anděl, J., Matematická statistika, SNTL, Praha, 1985.

Rao, C., R., Lineární metody statistické indukce a jejich aplikace, ACADEMIA, Praha, 1978.

Lamoš, F., Potocký, R., Pravdepodobnosť a matematická štatistika (štatistické analýzy), ALFA, Bratislava, 1989.

Wimmer, G., Multivariátna analýza 2 (študijné texty)

1. 22.IX.2015

Mnohorozmerné normálne rozdelenie –

Anděl, J., str. 74 –78,

(Wimmer)

2. 29.IX.2015

Pomocné tvrdenia z algebry

Anděl, J., str. 297 –300 (po Lemma 5) vrátane Vety IV.5 (str. 64)

3. 6.X.2015

Pomocné tvrdenia z algebry

Anděl, J., str. 300 –303 (od Lemmy 5 po Hlavní komponenty)

4. 13.X.2015

Hlavní komponenty

Anděl, J., str. 303 –307 (po Kanonické korelace)

5. 20.X.2015

Výberové hlavné komponenty

Lamoš, F., Potocký, R., str. 262 – 266

6. 27.X.2015

Kanonické korelace

Anděl, J., str. 307 –311<sup>14</sup> (vrátane Hadamardovej nerovnosti, koeficientu korelácie, koeficientu mnohonásobnej korelácie, skupinového korelačného koeficientu)

7. 3.XI.2015

Kanonické korelace

Anděl, J., str. 311<sup>14</sup> –313

Výberové kanonické korelácie  
Lamoš, F., Potocký, R , str. 281 – 283  
.....

8. 10.XI.2015  
Faktorová analýza I.  
Anděl, J., str. 313 – 317<sub>11</sub>  
.....

Faktorová analýza I.  
Anděl, J., str. 317<sub>11</sub> -- 319  
.....

9. 24.XI.2015  
Faktorová analýza II.  
Lamoš, F., Potocký, R , str. 269 – 272<sub>4</sub>  
.....

Faktorová analýza II.  
Lamoš, F., Potocký, R , str. 272<sub>4</sub> -- 277  
.....

10. 1.XII.2015  
Diskriminačná analýza I.  
Anděl, J., str. 319 -- 323  
.....

Diskriminačná analýza II.  
Lamoš, F., Potocký, R , str. 284 -- 291  
.....

11. 8.XII.2015  
Rozdelenie kvadratických foriem –  
Multivariátna analýza 2 str. 1-5, (po Vetu 1.7)  
.....

12. 15.XII.2015  
Rozdelenie kvadratických foriem (dokončenie).  
Wishartovo rozdelenie (úvod).  
Multivariátna analýza 2 str. 5-9, (po Dôsledok 2.2)  
.....