

Nemparaméteres statisztika vizsgatematika

1. Regressziós probléma, feltételes várható érték
2. Stone-tétel, a partíciós regresszióbecslés gyenge konzisztenciája és konvergenciasebessége, magfüggvény becslés, legközelebbi szomszédok módszere
3. Alakfelismerés
4. Glivenko-Cantelli tétel, halmazcsalád Vapnik-Chervonenkis dimenziója
5. Scheffé tétele, a sűrűségfüggvény hisztogram becslésének L_1 konzisztenciája
6. Aonstans újrásúlyozott portfóliók, log-optimális portfólió memóriánélküli piacokon, példák
7. Dinamikus portfóliók, log-optimális portfólió stacionárius piacokon
8. Empirikus portfólió-választás

Irodalom:

1-3 témakörökhöz: <http://www.cs.bme.hu/~gyorfi/booknonpar.pdf>

4-5 témakörökhöz: <http://www.szit.bme.hu/~kela/stat.pdf>

6-8 témakörökhöz: <http://www.cs.bme.hu/~oti/portfolio/icpproject/ch2.pdf>