

# 2019년 제 10회 통계세미나

통계연구소에서는 다음과 같이 통계 세미나를 개최하오니 많은 참여 바랍니다.

일시 : 2019년 11월 20일 (수) 오후 5시

장소 : 고려대학교 정경관 508호

연사 : 임채영 교수 (서울대학교)

## **Tail estimation of the spectral density matrix for multivariate Gaussian random fields**

<Abstract>

Multivariate stationary Gaussian random fields are widely used to fit multivariate spatial data. The one to one correspondence between (cross-)covariance functions and (cross-)spectral densities allows us to model (cross-)spectral densities instead of (cross-)covariance functions. In this talk, we consider multivariate stationary Gaussian random fields. Under some assumptions on high frequency behavior of (cross-)spectral densities, we introduce an approach to estimate parameters that control tail behaviors by minimizing a multivariate local Whittle likelihood type objective function.

고려대학교 통계연구소