



UNIVERSITÄT
ERFURT

Aktualisierung und weitere Informationen auf
www.cereb.eu

CEREB Short Lecture

Sommersemester 2010

Center for Empirical Research in Economics and Behavioral Sciences

Einführung in Bayesian Model Averaging

Prof. Dominik Maltritz, Universität Erfurt

22.06. 2010

29.06. 2010

06.07. 2010

jeweils 16 bis 18 Uhr (c.t.)
im Raum LG 1, 323

Bayesian Model Averaging ist ein Ansatz, der es ermöglicht, eine Vielzahl (unter Umständen alle) möglichen Modelle einer Modellklasse zu analysieren und dabei insbesondere die Modellunsicherheit zu berücksichtigen, während traditionelle statistische Ansätze nur eines oder ausgewählte Modelle betrachten und Modellunsicherheit vernachlässigt wird. Durch „Averaging“ über viele konkurrierende Modelle wird die Modellunsicherheit insbesondere auch in die Analyse von relevanten Parametern einbezogen. BMA wurde erfolgreich bei verschiedenen Modellklassen, wie z.B. linearer Regression, Generalized Linear Models und diskreten graphischen Modellen angewendet. Im Rahmen der Short-Lecture wird eine Einführung in die Grundidee des BMA am Beispiel von linearen Regressionsmodellen gegeben. Dazu werden außerdem ausgewählte Anwendungsbeispiele vorgestellt.