



07.08.2019

**Einladung**  
**zum**  
**Oberseminar „Stochastik“**

am **Donnerstag**, dem **26.09.2019**, um **14:45 Uhr** im **Seminarraum 1 (Raum 005)** der Abteilung  
Mathematik, Weyertal 86-90, 50931 Köln.

Es spricht

**Prof. Dr. Zuzana Prášková**  
**(Karls-Universität Prag)**

zum Thema:

**Monitoring changes in RCA(p) models revisited**

**Abstract:** We consider on-line procedures for detecting changes in parameters of a random coefficients autoregressive process and study the behaviour of the test statistic when different types of estimators of the parameters (LSE, WLSE, MLE and Schick-type estimators) are used. It is shown that stability of the procedure depends quite heavily on the choice of the type of the estimator.

Alle Interessenten sind herzlich eingeladen.

Die Dozenten der Stochastik