

**Multivariate Statistik**  
Wintersemester 2014/15  
PD Dr. Ralf Stecking

**Vorlesungstermin und –raum:**

Do. 10.15-11.45 Uhr, A14 1-112

**Übungstermin und –raum:**

Di. 18.15-19.45 Uhr, A4 3-307

Beginn: 23. Oktober 2014, Ende: 05. Februar 2015

**Inhalt**

Die Veranstaltung *Multivariate Statistik* vermittelt Fähigkeiten zur Auswahl und Anwendung multivariater Analyseverfahren zur datenbasierten Modellierung ökonomischer Fragestellungen aus den Bereichen Wirkungsanalyse, Prognose, Klassifikation und Segmentierung. Besonderer Wert wird auf die Anwendung praxisnaher Analysesoftware (SPSS) gelegt. In den begleitenden Übungen werden Fallstudien anhand realer ökonomischer Datensätze durchgeführt.

Die Veranstaltung besteht aus zwei Teilen: die theoretischen Grundlagen werden in der zweistündigen Vorlesung gelegt. In der zweistündigen Übung werden die theoretischen Modelle computergestützt in die Praxis umgesetzt.

## **Aufbau**

Die Veranstaltung *Multivariate Statistik* deckt folgende Teilbereiche ab:

- Regression und Klassifikation,
- Stepwise Regression,
- Kriterien zur optimalen Modellauswahl,
- Lineare Diskriminanzanalyse,
- Bewertung von Klassifikationsergebnissen,
- Hauptkomponentenanalyse,
- Variablenauswahl und –verdichtung.

## **Literatur**

Backhaus, Erichson, Plinke, Weiber (2011): *Multivariate Analysemethoden*, 13. Aufl., Springer, Berlin

Litz, H.P. (2000): *Multivariate Statistische Methoden*, Oldenbourg, München

Hartung, J. und Elpelt, B. (2006): *Multivariate Statistik*, 7. Aufl., Oldenbourg, München

Berthold, M. und Hand, D.J. (2010): *Intelligent Data Analysis*, 2. Aufl., Springer, Berlin

Witten, I.H. und Frank, E. (2011): *Data Mining*, 3. Aufl., Morgan Kaufmann, San Francisco