

Seminář aplikované statistiky

Kullback–Leiblerova divergence

Jan Kracík

Pátek 8. 3. 2013, 10:45–11:30, posluchárna B6

Kullback–Leiblerova divergence vyjadřuje míru nepodobnosti dvou pravděpodobnostních distribucí a přesto, že se nejedná o metriku, ji lze chápat jako přirozený nástroj pro vyjádření “vzdálenosti” dvou distribucí. Díky svým vlastnostem se jedná o důležitý teoretický i praktický nástroj v oblastech teorie pravděpodobnosti, teorie informace, matematické statistiky nebo strojového učení.

Na semináři budou vyloženy základní vlastnosti Kullback–Leiblerovy divergence. Dále se budeme věnovat zejména souvislostem s tématy z oblasti matematické statistiky.