

Prof. Dr. H. Luschgy

Vorlesungsankündigung für SS 2010

Funktionale Quantisierung für stochastische Prozesse

Zeit: Mi, 12 - 14

Ort: HS 9

Beginn: 14.04.2010

Funktionale Quantisierung für stochastische Prozesse ist die aktuelle Weiterentwicklung einer klassischen optimalen Diskretisierungsmethode zur Signalübertragung und basiert auf Approximationen durch Prozesse mit nur endlich vielen Pfaden und der Berechnung des funktionalen Quantisierungsfehlers. Das Quantisierungsproblem wird u.a. für die Brownsche Bewegung, Gauß-Prozesse und Lévy-Prozesse untersucht.

Voraussetzungen: Stochastische Prozesse I

Ausgewählte Literatur

Graf, S. Luschgy, H. (2000): Foundations of Quantization for Probability Distributions. Lecture Notes in Math. 1730, Springer.

Vakhania, N.N. et al. (1987): Probability Distributions on Banach spaces. Kluwer.