

Prof. Dr. H. Luschgy

Vorlesungsankündigung für SS 2013

Stabile Konvergenz von Zufallsvariablen

Zeit: Mi 12 - 14
Ort: HS 9
Beginn: 17.04.2013
Übungen: Mi 14 - 15, B 14

Die stabile Konvergenz von Zufallsvariablen ist eine interessante Verschärfung der Verteilungskonvergenz. Konsequenzen, die bei reiner Verteilungskonvergenz nicht bekannt sind, betreffen fast sichere Fluktuationen, Aufenthaltsmaße der Brownschen Bewegung, zufällige Indizes, empirische Maße und zufällige Normierungen. Wir demonstrieren, dass die meisten Grenzwertsätze stabil sind.

Kenntnisse der „Wahrscheinlichkeitstheorie“ sind erforderlich.

Die Veranstaltung kann zusammen z.B. mit der „Zeitreihenanalyse“ (SS 2013, Keller) als Vertiefungsmodul (M) gewählt werden.

Ausgewählte Literatur

- Castaing, C. et al. (2004). Young Measures on Topological Spaces, Kluwer Academic Publishers, Dordrecht.
- Florescu, L.C., Godet-Thobie, C. (2012). Young Measures and Compactness in Measure Spaces, De Gruyter, Berlin.
- Häusler, E., Luschgy, H. (2013). Stable convergence and stable Limit Theorems (In progress).
- Luschgy, H. (2012). Martingale in diskreter Zeit. Springer, Berlin.