

„Selecta der Wahrscheinlichkeitstheorie“

Hauptseminar Stochastik SS 2012
S2F1, Di 14-16, Raum 0.003

In dem Hauptseminar werden prominente, klassische Resultate der Wahrscheinlichkeitstheorie vorgestellt, die im Standard-Vorlesungszyklus aus Zeitgründen nicht behandelt werden. Hierzu zählen

- i) Gesetz vom iterierten Logarithmus von Hartman und Wintner
- ii) Satz von Cramér über große Abweichungen
- iii) Entropie und Satz von Sanov
- iv) Empirisches Gesetz der Großen Zahlen von Glivenko-Cantelli
- v) Satz von Berry-Esseen (ZGS mit Konvergenzabschätzung)
- vi) Multivariate Normalverteilung und mehrdimensionaler ZGS
- vii) Stabile Verteilung und Lévy-Khintchin-Formel
- viii) Stabile Grenzwertsätze
- ix) Metriken für stochastische und schwache Konvergenz (Ky Fan, Wasserstein, Lévy, totale Variation)
- x) Hausdorff-Maß

Voraussetzung: W-Theorie I

Vorbesprechung: Di 31.01.2012, 14.15, Raum 4.049