

Vorlesungsankündigung für das WS 2014/15

## **Asymptotische Statistik**

Vorlesung:

Di 08.15-09.45 Uhr F428

Übungen:

Mi 08.15-09.00 Uhr F142

Überblick:

Die Vorlesung liefert eine Einführung in die asymptotische Analyse von Folgen statistischer Experimente. Konvergieren solche Folgen in einem geeigneten Sinn, so lassen sich Optimalitätsaussagen für Folgen von statistischen Tests oder Schätzfunktionen über die Analyse des Limesexperiments erhalten.

Stichworte: Benachbarte Folgen von Wahrscheinlichkeitsmaßen, lokale asymptotische Normalität, asymptotisch reguläre Schätzfolgen, Konvergenz von Experimenten, asymptotische Effizienz.

Voraussetzungen: Die Vorlesung "Mathematische Stochastik II"

Module: Spezialisierung Bachelor Stochastik; Vertiefungs- oder Wahlmodule, Bereich Angewandte Mathematik.

Literatur:

Strasser, H. (1985). *Mathematical Theory of Statistics*. de Gruyter, Berlin.

van der Vaart, A. (2000). *Asymptotic Statistics*. Cambridge University Press, Cambridge.

Witting, H. und Müller-Funk, U. (1995). *Mathematische Statistik II*. Teubner, Stuttgart.

Beginn: Dienstag, 14.10.2014