

Vorlesungsankündigung für das SS 2012

Empirische Prozesse

Vorlesung:

Di 10.15-11.45 Uhr G117

Übungen:

Fr 09.15-10.00 Uhr G123

Überblick:

Statistische Schätz- und Testgrößen sind Funktionale von empirischen Prozessen. Grenzwertsätze für solche Größen können vielfach in einfacher Weise über Grenzwertsätze für empirische Prozesse erhalten werden. In dieser Vorlesung soll vor allem die schwache Konvergenz empirischer Prozesse behandelt werden.

Stichworte: Satz von Donsker, Vapnik-Chervonenkis-Klassen, Bootstrap-Verfahren

Voraussetzung: Die Vorlesung "Mathematische Stochastik II"

Module: Spezialisierung Bachelor Stochastik (PO 2006/2008); Einstieg Master Stochastik (PO 2008); Spezialisierung Master Stochastik (PO 2008); Vertiefungs- oder Wahlmodule, Bereich Angewandte Mathematik (PO 2010).

Literatur:

Pollard, D. (1990). *Empirical processes: Theory & Applications*. NSF-CBMS Regional Conference Series in Probability and Statistics, Vol. 2, IMS, Hayward.

Pollard, D. *Convergence of Stochastic Processes*. Springer, New York 1984.

Shorack, G.R. and J.A. Wellner (1986). *Empirical Processes with Applications to Statistics*. Wiley, New York.

van der Vaart, A. and J. Wellner (2000). *Weak Convergence and Empirical Processes*. Springer, New York.

Beginn: Dienstag, 10.4.2012