

Seminar “Große Abweichungen”

Zeit und Ort: Di 14-16, Raum B039.

Themen:

- (1) *Satz von Cramér in \mathbb{R} .*
[DZ], Abschnitt 2.2.1
- (2) *Satz von Cramér in \mathbb{R}^d .*
[DZ], Abschnitt 2.2.2
- (3) *Satz von Gärtner-Ellis.*
[DZ], Abschnitt 2.3
- (4) *Ungleichungen für beschränkte Martingaldifferenzen.*
[DZ], Abschnitt 2.4.1
- (5) *Konzentrationsungleichungen von Talagrand.*
[DZ], Abschnitt 2.4.2
- (6) *Satz von Sanov.*
[DZ], Abschnitt 3.2
- (7) *Hypothesentest und verallgemeinerter Likelihood-Quotienten-Test.*
[DZ], Abschnitt 3.2
- (8) *Moderate Abweichungen und exakte Asymptotik in \mathbb{R}^d*
[DZ], Abschnitt 3.7
- (9) *Prinzipien großer Abweichungen*
[DZ], Abschnitt 4.1
- (10) *Integrallemma von Varadhan.*
[DZ], Abschnitte 4.3 und 4.4

Bei genügender Nachfrage können weitere Themen vergeben werden. Anmeldungen bitte per E-mail an merkl“at”math.lmu.de oder persönlich zur ersten Sitzung am Dienstag, den 25.4.2017

Literatur:

[DZ] A. Dembo, O. Zeitouni: *Large Deviations Techniques and Applications*. Springer Applications of Mathematics 38, 2. Auflage 1998.