

Übungen

Abgabetermin: Dienstag, 7.12.2008, 10:15 Uhr

Aufgabe 14. (5 Punkte)

Geben Sie eine positive Funktion β an, so dass

$$\lim_{u \rightarrow x_r} \sup_{0 < x < x_R - u} |F_u(x) - G_{\xi, \beta(u)}(x)| = 0,$$

wenn G die verallgemeinerte Pareto-Verteilung bezeichnet und

a) $F \in \mathcal{D}(\Phi_1)$,

b) $F \in \mathcal{D}(\Psi_1)$.