

Prof. Dr. Matthias Löwe

PD Dr. Michael Stolz

Master-Seminar über Konzentrationsungleichungen für Gaußsche und Empirische Prozesse

im WS 2016/17

Wie wahrscheinlich ist es, dass das Supremum eines stochastischen Prozesses um mehr als einen vorgegebenen Abstand d oberhalb des erwarteten Supremums liegt?

Fragen dieses Typs wollen wir in einem nichtasymptotischen Sinn beantworten, d. h., wir wollen Theoreme beweisen, die wirklich etwas über Stichproben von endlichem Umfang aussagen. Konkret soll es um Gaußsche Prozesse gehen (zu denen etwa die Brownsche Bewegung gehört) sowie um Empirische Prozesse, also funktionale Versionen der empirischen Verteilungsfunktion. Beide Prozessklassen spielen eine wichtige Rolle in der modernen nichtparametrischen Statistik und im Statistischen Lernen.

Vorbesprechung:

Donnerstag, **21.07.2016, 14:00 Uhr** im **Raum 130.005**

(Besprechungsraum des Instituts für Mathematische Statistik).

Falls Sie zur Vorbesprechung verhindert sein sollten, schreiben Sie bitte ein E-mail an maloewe@uni-muenster.de oder michael.stolz@uni-muenster.de