

Schwerpunkt ST
Mathematische Statistik und
Stochastische Prozesse
FB Mathematik, Bundesstr. 55,
20146 Hamburg

**Gastvorlesung
vom 18.6.-15.7.2003**

**Prof. Dr. Vydas Cekanavicius
Universität Vilnius, Litauen**

Accuracy of approximations in limit theorems

Inhalt:

Probabilistic approximations are widely used in Statistics, Econometrics and Actuarial Mathematics. Our aim is to learn methods for estimating of their accuracy. The methods were chosen to represent modern approaches as well as the classical ones. We will get operational knowledge of the characteristic function method for lattice variables, the triangular function method for compound approximations and the Stein method for Poisson approximation. The emphasis is on the practical usage of the methods rather than on their theoretical background. All necessary material will be provided. Prerequisites: it suffices to know definitions of characteristic functions, distributions and means.

Die Gastvorlesung wird in Englisch abgehalten und umfasst 8 Stunden pro Woche. Diese sind aufgeteilt auf 4 Stunden Vorlesung und 4 Stunden Übungen. Die Übungen am Montag werden als Diskussionsrunde gestaltet.

Montag: 10.15-11.45 Übungen, 2st., *Geom T03*

Mittwoch: 8.30-10.00 Vorlesung, 2st., Geom 434

Mittwoch: 10.15-11.45 Übungen, 2st., Geom 434

Freitag: 10.15-11.45 Vorlesung, 2st., Geom 434

Beginn: Mittwoch, 18.06.2003

Herzlich eingeladen sind: Studierende, Lehrende und Interessenten der Stochastik.

Den Diplomanden des SP Stochastik wird die Teilnahme wärmstens empfohlen.