

A VALÓSZÍNŰÉGSZÁMÍTÁS HATÁRELOSZLÁS ÉS NAGY ELTÉRÉS TÉTELEI ZÁRÓVIZSGA TÉTELSOR

1. Valószínűségi mértékek gyenge konvergenciája:

gyenge konvergencia fogalma, feszesség, bizonyítás alapmódszerei (puszta kézzel, momentumokkal, karakterisztikus függvénnyel)

2. A tükrözési elv és alkalmazásai:

1-dimenziós egyszerű szimmetrikus bolyongás és Brown-mozgás maximumának és elérési ideinek eloszlása és határeloszlása, arcus-sinus tételek

3. Karakterisztikus függvény:

minden a karakterisztikus függvényről

4. Centrális határeloszlás tétel-kör:

De Moivre tétel változatai, klasszikus CHT, Lindeberg tétel

5. Stabilis eloszlások:

Stabilitás, stabilis eloszlások karakterizációja (szimmetrikus és nem-szimmetrikus esetek egyaránt), gyenge konvergencia stabilis eloszláshoz

6. Korlátlanul osztható eloszlások:

Korlátlan oszthatóság, jelentősége, összetett Poisson eloszlások, Lévy-Hincsin formula, Poisson-pontfolyamatok, korlátlanul osztható eloszlású valószínűségi változó előállítás a Poisson-pontfolyamatból

7. Nagy eltérések:

Bernstein-egyenlőtlenség, Cramer-tétel