

SEMINÁRIO DE PROBABILIDADE

Lei do Logaritmo Iterado para Martingales

Alessandra Kreutz

Universidade de Brasília

20/10/2017

14:15 Horas

Miniauditório do MAT

Resumo. Apresentaremos alguns resultados sobre a Lei do Logaritmo Iterado (LLI) para martingales. Trataremos principalmente das generalizações dadas por Stout. E, também, da generalização dada por Hall e Heyde do princípio da invariância da LLI no caso martingale que estende o resultado de Strassen.

Bibliografia

- [1] BILLINGSLEY, P., Probability and Measure, Wiley, 2011.
- [2] CHOW, Y.S., STUDDEN, W.J., Monotonicity of the variance under truncation and variations of Jensen's inequality, Ann.Math.Statist., 40, 1106-1108, 1969.
- [3] HALL, P., HEYDE, C.C., Martingale Limit Theory and Its Application, Academic Press, 1980.
- [4] HALL, P., HEYDE, C.C., On a unified approach to the law of the iterated logarithm for martingales, Bulletin of the Australian Mathematical Society, 14(3), 435-447, 1976.
- [5] KOLMOGOROV, A., Über das Gesetz des iterierten Logarithmus, Math. Ann. 101, 126-135, 1929.
- [6] STRASSEN, V., An invariance principle for the law of the iterated logarithm, Z. Wahrscheinlichkeitstheorie und verw. Gebiete 3, 211-226, 1964.
- [7] STOUT, W.F., A martingale analogue of Kolmogorov's law of the iterated logarithm, Z. Wahrscheinlichkeitstheorie und Verw. Gebiete, 15, 279-290, 1970.
- [8] STOUT, W.F., The Hartman-Wintner law of the iterated logarithm for martingales, The Annals of Mathematical Statistics, vol. 41, 6, 2158-2160, 1970.