



*Sommersemester/April 2014*

Im Sommersemester 2014 halte ich die Vorlesung

## *Stochastik I*

### Inhalt:

Einführung in die zur Analyse zufälliger Erscheinungen entwickelten mathematischen Ideen und Methoden, Gesetze der großen Zahlen und zentrale Grenzwertsätze, Elemente der Mathematischen Statistik.

### Voraussetzungen:

Module „Lineare Algebra und Analytische Geometrie“ I und II sowie „Analysis“ I und II; Sowie die Maßtheorie (auf allgemeinen Maßräumen) im Umfang wie in der Vorlesung Analysis III, wobei es ggf. ausreicht, die Maßtheorie parallel zu studieren (Kurs Maßtheorie (32503) Dr. H. Mai, mittwochs 13 – 15 Uhr, RUD 25, Raum 1.013).

### Literatur:

Georgii, H.-O.: Stochastik, De Gruyter Verlag, 2007.

<http://www.degruyter.com/viewbooktoc/product/38900>

Klenke, A.: Wahrscheinlichkeitstheorie, Springer, 2008. (weiterführend auch für Stochastik II, inkl. Maßtheorie) <http://dx.doi.org/10.1007/978-3-540-77571-3>

Jacod, Protter: Probability Essentials, Springer, 2000.

Širjaev, Albert N.: *Wahrscheinlichkeit*, (z.B. Dt. Verlag der Wissenschaft, 1988) oder Širjaev, Albert N.: Probability, Springer, 1996

### Ergänzend:

Elstrodt, J.: Maß- und Integrationstheorie, Springer, 2007.

### Ort und Zeit:

Mo, 11.00 – 12.30 Uhr, RUD 26, Raum 0‘110

Mi, 11.00 – 13.30 Uhr, RUD 26, Raum 0‘110

**Beginn: am 16. 04. 2014**

### Übungen: Übungsleitung: M. Büttner, P. Frentrup, und K. Tonleu

Mo, 13 – 15 Uhr, RUD 25, Raum 3.006 (D. Becherer)

Mi, 09 – 11 Uhr, RUD 25, Raum 3.006 (K. Tonleu)

Mi, 13 – 15 Uhr, RUD 25, Raum 1.011 (P. Frentrup)

Mi, 13 – 15 Uhr, RUD 25, Raum 3.006 (M. Büttner)

**Beginn: am 16. 04. 2014**

Aktuelle Information: <http://www.math.hu-berlin.de/~becherer/>

Sprechstunden: nach Vereinbarung