



Im Wintersemester 2011 halte ich die Vorlesung

*Stochastik II*  
(Stochastic Processes)

Inhalt:

Bedingte Erwartungen, Martingale in diskreter Zeit: Stopp- und Konvergenzsätze mit Anwendungen, Konstruktion stochastischer Prozesse, Markov-Ketten, Schwache Konvergenz von Maßen, Invarianzprinzip und Brownsche Bewegung

Voraussetzungen:

Modul I „Lineare Algebra und Analytische Geometrie I und II“, Modul 2 „Analysis I und II“, Teilmodul 6a „Maßtheorie“ und Modul 8 „Stochastik I“.

Literatur:

Klenke, A.: *Wahrscheinlichkeitstheorie*, Springer, 2008. (online im HU-Netz verfügbar)  
Jacod, J. / Protter, Ph.: *Probability Essentials*, Springer 2000  
Rogers, L.C.G. / Williams, D.: *Diffusions, Markov Processes and Martingales*; Vol 1  
Širjaev, Albert N.: *Wahrscheinlichkeit*, (z.B. Dt. Verlag der Wissenschaft, 1988)  
Bauer, Heinz; *Wahrscheinlichkeitstheorie*, de Gruyter 2002

Vorlesung (Prof. Becherer):

Di, 11 – 13 Uhr, RUD 25, Raum 1.115  
Do, 11 – 13 Uhr, RUD 25, Raum 1.115

Beginn: **am 19. 10. 2010**

Übung (N.N.):

Do, 13 – 15 Uhr, RUD 25, Raum 3.007

Sprechstunden: nach Vereinbarung