

Vorlesungsankündigung

Im Wintersemester 2020/21 halte ich die Vorlesung

Stochastik II

Vorlesung:

Über moodle wird wöchentlich ein ausführliches Skript zur Verfügung gestellt.
Besprechung und Beantwortung von Fragen erfolgen über zoom, nach Absprache
Dienstag 11:15 Uhr oder Donnerstag 9:15 Uhr.
Alle Informationen über moodle. Bitte schreiben Sie sich rechtzeitig in Agnes ein.

Übung: (Bernhard Stankewitz): Dienstag 13:15-14:45 Uhr (via zoom)

Inhalt:

Poissonprozess, Konstruktion stochastischer Prozesse, bedingte Erwartungen, Martingale und Stoppzeiten, Martingalkonvergenzsätze, Ergodensätze, Markovprozesse, Wahrscheinlichkeitsmaße auf Polnischen Räumen, Brownsche Bewegung und Brownsche Brücke, Sätze von Donsker

Voraussetzungen: Stochastik I (inklusive Maßtheorie)

Literatur:

H. Bauer, *Wahrscheinlichkeitstheorie*, de Gruyter
R. M. Dudley, *Real Analysis and Probability*, Cambridge University Press
G. Grimmet, D. Stirzacker, *Probability and Random Processes*, Oxford University Press
J. Jacod, P. Protter, *Probability Essentials*, Springer
A. Klenke, *Wahrscheinlichkeitstheorie*, Springer
D. Meintrup, S. Schäffler, *Stochastik: Theorie und Anwendungen*, Springer
D. Williams, *Probability with Martingales*, Cambridge University Press

Alle Bücher außer das letzte sind als *eBook* über die HU-Bibliothek verfügbar!