

Modulbeschreibung für Vertiefungsmodule des Wahlpflichtbereiches

Titel des Moduls	Ausgewählte Kapitel der stochastischen Analysis
In englischer Sprache	Selected topics in Stochastic Analysis

R	
A	X

	Vorlesung	Übung
Umfang	2	-

Inhalt

Backward Stochastic Differential Equations and Stochastic Analysis for Processes with Jumps: Lévy Processes & Random Measures, Stochastic Differential Equations (with Jumps). Backward – SDES, (classical Lipschitz and beyond: Quadratic, Jumps...), Non-linear Feymann-Kac, Applications to Stochastic Optimal Control and Finance as time permits.

Voraussetzungen	Ito-Calculus for Brownian Motion, as e.g. provided by Lecture Stochastic Analysis/Stochastic Processes
------------------------	--

Regelsemester	ab 6. Semester
----------------------	----------------

Abschluss	Mündliche Prüfung / oral examination
------------------	--------------------------------------

Prüfungszulassungsvoraussetzung	keine
--	-------

Studienpunkte	4
----------------------	---

R = Reine Mathematik

A = Angewandte Mathematik