

Modulbeschreibung für Vertiefungsmodule des Wahlpflichtbereiches

Titel des Moduls	Markovsche Prozesse
in englischer Sprache	Markov Processes

R	
A	X

	Vorlesung	Übung
Umfang	2	1

Inhalt	
<p>Markovprozesse in stetiger Zeit, Übergangsfunktionen, Halbgruppen linearer Operatoren, infinitesimale Operatoren, Satz von Hille-Yosida, Markovprozesse und stochastische Differentialgleichungen, Diffusionsprozesse, Levy-Prozesse, Markovprozesse und Martingale, Markovsche Ketten in stetiger Zeit, Kolmogorovsche Differentialgleichungen, Anwendungen in Mathematischer Finanzmathematik, Biologie und anderen Gebieten</p>	

Voraussetzungen	Stochastik I, Stochastische Prozesse
------------------------	--------------------------------------

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

Abschluss	Prüfung
------------------	---------

Prüfungszulassungsvoraussetzung	keine
--	-------

Studienpunkte	5
----------------------	---

R = Reine Mathematik
A = Angewandte Mathematik