

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