

Modulbeschreibung für Vertiefungsmodule des Wahlpflichtbereiches

Titel des Moduls	Stochastische Analysis II
-------------------------	---------------------------

R	
A	

	Vorlesung	Übung
Umfang	2	-

Inhalt	
	Stochastische Differenzialgleichungen: schwache Lösungen, Lokalzeiten; Martingalproblem und parabolische partielle Differenzialgleichungen; stochastische Rückwärtsgleichungen und Kontrolltheorie; Anwendungen auf Optimierungsprobleme in der Finanzmathematik

Voraussetzungen	Modul 28 Stochastische Analysis (A):
------------------------	---

Regelsemester	Ab 6. oder 7. Fachsemester
----------------------	----------------------------

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

Prüfungszulassungsvoraussetzung	
--	--

Studienpunkte	
----------------------	--

R = Reine Mathematik
A = Angewandte Mathematik