

Vorlesungsankündigung für das WiSe 2014/15

Mathematische Stochastik II

TV 4	Mo	10 – 12 Uhr	F 428
	Do	16 – 18 Uhr	F 428
	Do	10 – 12 Uhr	F 428
	Block	4. – 8.2. 2015	F 428
TU	Fr	10 – 12 Uhr	F 442
	Block	7. & 8.2. 2015	F 428
Tutorium	nach Ankündigung		

Die exakten Termine inklusive der Blockveranstaltung werden in der ersten Vorlesung angekündigt.

Inhalt:

Die Vorlesung setzt die Stochastik I fort und ist Voraussetzung für alle weiterführenden Vorlesungen im Bereich der Stochastik inklusive der Versicherungs- und Finanzmathematik.

1. Wahrscheinlichkeitstheorie

- (a) Bedingte Erwartungen
- (b) Martingale, Supermartingale, Submartingale
- (c) Martingalkonvergenz
- (d) Der Satz von Radon-Nikodym

2. Statistik

- (a) Parameterschätzung
- (b) Konfidenzbereiche
- (c) Testen von Hypothesen
- (d) Regressions- und Varianzanalyse

Literatur:

- Georgii, Hans-Otto: *Stochastik*, Walter de Gryuter, 2009.
- Jacod, Jean & Philip Protter: *Probability Essentials*, Springer, 2004.