

Vorlesungsankündigung für das WS 10/11

MATHEMATISCHE STOCHASTIK II

10150	TV 4	Di	12.15 - 13.45 Uhr	F 128
		Fr	10.15 - 11.45 Uhr	F 442
10151	TU	Mi	13.15 - 14.45 Uhr	F 142

Gegenstand der Vorlesung sind die klassischen Resultate der Wahrscheinlichkeitstheorie, insbesondere die Gesetze der großen Zahlen und der Zentrale Grenzwertsatz, sowie deren Anwendungen, beispielsweise in der mathematischen Statistik. Auch neuere Entwicklungen, insbesondere die Theorie der Martingale, werden behandelt.

Die Vorlesung "Mathematische Stochastik II" ist für das Verständnis aller weiterführenden Vorlesungen zur Wahrscheinlichkeitstheorie und Mathematischen Statistik notwendig.

Vorkenntnisse:

Analysis, Lineare Algebra, Math. Stochastik I

Literatur:

- Bauer, H. (1990). *Wahrscheinlichkeitstheorie*. De Gruyter, Berlin
- Billingsley, P. (1985) *Probability and Measure*. Wiley, New York
- Dudley, R.M. (1989) *Real Analysis and Probability*. Wadsworth & Books
- Feller, W. (1968 u. 1966) *An Introduction to Probability Theory and Its Applications*.
Vol. I, II, Wiley
- Georgii, H.-O. (2002) *Stochastik Einführung in die Wahrscheinlichkeitstheorie und Statistik*.
de Gruyter, Berlin
- Williams, D. (1991) *Probability with Martingales*. Cambridge Mathematical Textbooks

Beginn: 19. Oktober 2010