

INSTITUT FÜR MATHEMATISCHE STOCHASTIK
LEIBNIZ UNIVERSITÄT HANNOVER
Prof. Dr. Stefan Tappe

Seminarankündigung für das Wintersemester 2014/15

Stochastische Analysis

Veranstalter: Prof. Dr. Stefan Tappe

Voraussetzungen: Stochastik I, Stochastik II und Stochastische Analysis.

Überblick: Aufbauend auf der Vorlesung „Stochastische Analysis“ aus dem Sommersemester 2014 werden wir verschiedene Themen aus dem Bereich der Stochastischen Analysis behandeln; hierbei sind unter anderem geplant:

- Das Invarianzprinzip von Donsker
- Martingal-Darstellungssätze
- Stochastische Differentialgleichungen
- Die lokalen Charakteristiken von Semimartingalen
- Unbegrenzt teilbare Verteilungen und Lévy Prozesse

Das Seminar ist für Studierende des Masterstudiengangs Mathematik geeignet. Das Vortragsthema kann nach Absprache ein möglicher Ausgangspunkt für eine Masterarbeit sein.

Termin: Nach Vereinbarung.

Anmeldung: Per Email an tappe@stochastik.uni-hannover.de

Literatur:

- Jacod, J., Shiryaev, A. N. (2003): *Limit theorems for stochastic processes*. Springer-Verlag, Berlin
- Karatzas, I., Shreve, S. E. (1991): *Brownian motion and stochastic calculus*. Springer-Verlag, New York
- Revuz, D., Yor, M. (1999): *Continuous martingales and Brownian motion*. Springer-Verlag, Berlin