

Informationsblatt zur Vorlesung Wahrscheinlichkeitstheorie III

Dozent:	Dr. Noemi Kurt	Raum MA 783 Sprechstunde: Mi 13:30–15:00
Tutor:	Adrian Gonzalez-Casanova	Raum MA 766
Sekretariat:	Frau Maria Willmers	Raum MA 747 Sprechstunde: Mo-Fr 09:30–11:30 außer Mittwoch
Vorlesung:	Montag 10:15–11:45 Montag 14:15–15:45	MA 749 MA 749
	Erste Vorlesung:	Montag 16. 4. 12
Tutorium:	Donnerstag 12:15–13:45 Erstes Tutorium:	MA 748 Donnerstag 19. 4. 12

Voraussetzungen: Wahrscheinlichkeitstheorie I und II.

Prüfungen: Mündlich. Voraussetzung zur Prüfung ist die Teilnahme an der Vorlesung.

Ablauf: Vierstündige Vorlesung ohne Übungen und ohne Hausaufgaben. Als freiwilliges Zusatzangebot findet ein Tutorium statt.

Stoff: Stochastische Prozesse in stetiger Zeit, Markov-Prozesse, Generatoren, Halbgruppen, Dualität, Martingale, Itô-Integral, Diffusionsprozesse.

Hinweis: Dieses Semester findet auch eine Vorlesung über stochastische Analysis bei Prof. Dr. Martin Keller-Ressel statt. In der Wahrscheinlichkeitstheorie III wird deshalb der Schwerpunkt auf der allgemeinen Theorie der Markov-Prozesse liegen.

Skript: Skript von Prof. Dr. Jochen Blath, vorläufige Version (Kopiervorlage gegen Studentenausweis bei Frau Willmers erhältlich). Weitere Literatur wird in der Vorlesung angegeben.

Homepage: <http://www3.math.tu-berlin.de/Vorlesungen/SS12/WT3>