



Stochastische Analysis II (V+Ü = 2+1 SWS)

- KAPITEL 3: DIE ITÔ-FORMEL
Partielle Integration, Itô-Formel
- KAPITEL 4: ANWENDUNGEN IN DER ANALYSIS
Dirichlet-Problem, Poisson-Problem, Feynman-Kac-Formel, Girsanov-Theorie
- KAPITEL 5: MEYER-TANAKA-FORMEL UND ANWENDUNGEN
Lokale Zeit, Arcsin-Gesetz von Lévy
- KAPITEL 6: STOCHASTIK DER FINANZMÄRKTE

Die Vorlesung wendet sich an **Master**-Studenten aller **Mathematik**studiengänge.

Teilnahmebedingung ist, dass **mindestens eins** der Module „Stochastische Prozesse“ oder „Brownsche Bewegung“ besucht wurde.

Die Veranstaltung baut auf den im SS 2012 gehaltenen **ersten Teil** auf (ebenfalls V+Ü = 2+1 SWS), über beide Teile kann dann eine gemeinsame Fachprüfung abgelegt werden.

Achtung: Die erste Vorlesung findet erst am **Mittwoch, 31. Oktober** statt. Im Laufe des Semesters werden daher drei Vorlesungen (zum Übungstermin) nachgeholt.