

Prof. Dr. H. Luschgy

Seminarankündigung für SS 2013 Zeitdiskrete Martingale und Anwendungen

Zeit: Di 16 – 18

Martingale haben wie kaum eine andere Klasse von stochastischen Prozessen die Wahrscheinlichkeitstheorie revolutioniert. Im Seminar sollen Aspekte der zeitdiskreten Martingalthorie besprochen werden.

Das Seminar basiert auf dem Buch

Luschgy, H. (2012). Martingale in diskreter Zeit, Springer, Berlin.

Kenntnisse der Vorlesungen Wahrscheinlichkeitstheorie sind erforderlich.

Eine Vorbesprechung findet am

Dienstag, 12.02.2013, 14.15 Uhr im E 10

statt.