



Sommersemester/April 2014

Im Sommersemester 2014 halte ich die Vorlesung

Stochastik I

Inhalt:

Einführung in die zur Analyse zufälliger Erscheinungen entwickelten mathematischen Ideen und Methoden, Gesetze der großen Zahlen und zentrale Grenzwertsätze, Elemente der Mathematischen Statistik.

Voraussetzungen:

Module „Lineare Algebra und Analytische Geometrie“ I und II sowie „Analysis“ I und II; Sowie die Maßtheorie (auf allgemeinen Maßräumen) im Umfang wie in der Vorlesung Analysis III, wobei es ggf. ausreicht, die Maßtheorie parallel zu studieren (Kurs Maßtheorie (32503) Dr. H. Mai, mittwochs 13 – 15 Uhr, RUD 25, Raum 1.013).

Literatur:

Georgii, H.-O.: Stochastik, De Gruyter Verlag, 2007.

<http://www.degruyter.com/viewbooktoc/product/38900>

Klenke, A.: Wahrscheinlichkeitstheorie, Springer, 2008. (weiterführend auch für Stochastik II, inkl. Maßtheorie) <http://dx.doi.org/10.1007/978-3-540-77571-3>

Jacod, Protter: Probability Essentials, Springer, 2000.

Širjaev, Albert N.: *Wahrscheinlichkeit*, (z.B. Dt. Verlag der Wissenschaft, 1988)

oder Širjaev, Albert N.: Probability, Springer, 1996

Ergänzend:

Elstrodt, J.: Maß- und Integrationstheorie, Springer, 2007.

Ort und Zeit:

Mo, 11.00 – 12.30 Uhr, RUD 26, Raum 0‘110

Mi, 11.00 – 13.30 Uhr, RUD 26, Raum 0‘110

Beginn: am 16. 04. 2014

Übungen: Übungsleitung: M. Büttner, P. Frentrup, und K. Tonleu

Mo, 13 – 15 Uhr, RUD 25, Raum 3.006 (D. Becherer)

Mi, 09 – 11 Uhr, RUD 25, Raum 3.006 (K. Tonleu)

Mi, 13 – 15 Uhr, RUD 25, Raum 1.011 (P. Frentrup)

Mi, 13 – 15 Uhr, RUD 25, Raum 3.006 (M. Büttner)

Beginn: am 16. 04. 2014

Aktuelle Information: <http://www.math.hu-berlin.de/~becherer/>

Sprechstunden: nach Vereinbarung