

SEMINARANKÜNDIGUNG
für das Sommersemester 2015

Martingale

Veranstalter: R. Grübel

Voraussetzungen: Vertiefte Kenntnisse in der Stochastik

Martingale sind stochastische Prozesse, die in dem Sinn ausgewogen sind, dass der gegenwärtige Zustand die beste Vorhersage für einen zukünftigen Wert liefert. Solche Prozesse sind ein zentraler Gegenstand der modernen Stochastik, mit zahlreichen inner- und außermathematischen Anwendungen.

Aufbauend auf den hierzu in der Vorlesung Stochastik II erworbenen Vorkenntnissen sollen verschiedene Martingal-Themen vertieft werden, insbesondere Ungleichungen, Grenzwertsätze und Anwendungen. Details können gern persönlich mit dem Veranstalter besprochen werden (Di 14-15 Uhr, oder nach Vereinbarung per email, s.u.).

Das Seminar ist geeignet für Studierende in den Studiengängen Bachelor und Master Mathematik.

Termin: Nach Vereinbarung.

Anmeldung: Bis 28. Februar 2015, per email: rgrubel@stochastik.uni-hannover.de

Literatur: Luschgy, H. (2012) *Martingale in diskreter Zeit*. Springer-Spektrum, Heidelberg.