

Seminarankündigung

In diesem Seminar werden Ergänzungen zur Vorlesung „Stochastische Differentialgleichungen“ in Einzelvorträgen besprochen. Zu den Themen gehören:

- Die Burkholder-Davis-Gundy Ungleichung für stochastische Integrale, eine Verallgemeinerung der Itô-Isometrie
- Die Dualität von Itô-Prozessen
- Der Martingaldarstellungssatz
- Stochastische Rückwärtsdifferentialgleichungen
- Verallgemeinerung der Feynman-Kac Formel

Vorbesprechung: 09. Februar 2018, 11.30 Uhr, Raum 2.042