

Prof. Dr. J. Woerner
LS IV Stochastik

Seminar Stochastik
SS 22

Aufbauend auf Kenntnisse der Vorlesung Stochastik II werden wir das Thema Lévy Prozesse erarbeiten, u.a. ihre Existenz, Darstellungsmöglichkeiten, Pfad- und Verteilungseigenschaften. Lévy Prozesse sind zeitstetige stochastische Prozesse mit stationären und unabhängigen Zuwächsen, deren Randverteilungen unendliche Teilbare Verteilungen sind. Lévy Prozesse verallgemeinern die Brownsche Bewegung und führen zu Prozessen mit Sprüngen, wie sie bei vielen Anwendungen, z.B. Aktienpreismodellen wünschenswert sind.

Literatur:

Ken-Iti Sato, Lévy processes and infinitely divisible distributions, CUP, 1999.

Vorbesprechung: Do 3.2.2021, 14:00 Uhr,
<https://tu-dortmund.webex.com/meet/jeannette.woerner>