

Vertiefungsmodul

Modulnummer	M23
Modulname	Stochastische Analysis
Modulverantwortlich	Studiendekan der Fakultät für Mathematik
Inhalte und Qualifikationsziele	<p><u>Inhalte:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> • Eigenschaften der Brownschen Bewegung • Stochastische Integration • Ito-Integral • Anwendungen der Stochastischen Integration <p><u>Qualifikationsziele:</u> In diesem Modul werden die Integration bezüglich eines stochastischen Prozesses mathematisch fundiert eingeführt, deren grundlegende Eigenschaften behandelt und die Anwendungsbezüge der stochastischen Integration vermittelt.</p>
Lehrformen	<p>Lehrform des Moduls ist die Vorlesung.</p> <ul style="list-style-type: none"> • V: Stochastische Analysis (2 LVS) <p>Die Lehrveranstaltung kann in englischer Sprache angeboten werden.</p>
Voraussetzungen für die Teilnahme	Stochastik (Modul B10), Stochastische Prozesse (Modul M17)
Verwendbarkeit des Moduls	
Voraussetzungen für die Vergabe von Leistungspunkten	Die erfolgreiche Ablegung der Modulprüfung ist Voraussetzung für die Vergabe von Leistungspunkten.
Modulprüfung	<p>Die Modulprüfung besteht aus einer Prüfungsleistung:</p> <ul style="list-style-type: none"> • 30-minütige mündliche Prüfung
Leistungspunkte und Noten	<p>In dem Modul werden 4 Leistungspunkte erworben.</p> <p>Die Bewertung der Prüfungsleistung und die Bildung der Modulnote sind in § 10 der Prüfungsordnung geregelt.</p>
Häufigkeit des Angebots	Das Modul wird mindestens einmal in jedem zweiten Studienjahr angeboten.
Arbeitsaufwand	Das Modul umfasst einen Gesamtarbeitsaufwand der Studierenden von 120 AS.
Dauer des Moduls	Bei regulärem Studienverlauf erstreckt sich das Modul auf ein Semester.