

Inhaltsverzeichnis

KURSEINHEIT 1

1	Der Begriff des stochastischen Prozesses	1
1.1	Einleitung	2
1.2	Beispiele	4
1.3	Einführende Begriffsbildung	11
1.4	Überblick über den Kurs	14
2	Mathematische Grundlagen	15
2.1	Produkte von messbaren Räumen (Teil I)	16
	Lösungen	20

KURSEINHEIT 2

2.1	Produkte von messbaren Räumen (Teil II)	1
2.2	Koppelungen von Experimenten, Satz von Kolmogoroff	3
3	Der Poisson–Prozess	17
3.1	Definition des homogenen Poisson–Prozesses (Teil I)	18
	Lösungen	20

KURSEINHEIT 3

3.1	Definition des homogenen Poisson–Prozesses (Teil II)	1
3.2	Verteilung der Zuwächse des homogenen Poisson–Prozesses	4
3.3	„Axiomatische“ Einführung des Poisson–Prozesses	10
	Lösungen	19

KURSEINHEIT 4

3.4	Ergänzungen	1
4	Der Wiener–Prozess	7
4.1	Einführung, Motivation	8
4.2	Existenz von Wiener–Prozessen	10
4.3	Ergänzungen (Teil I)	16
	Lösungen	18

KURSEINHEIT 5

4.3	Ergänzungen (Teil II)	1
4.4	Stetigkeit von stochastischen Prozessen	3
5	Separable stochastische Prozesse; analytische Eigenschaften von Pfaden	7
5.1	Einführung	8

5.2 Separabilität von stochastischen Prozessen	11
Lösungen	20

KURSEINHEIT 6

5.3 Eigenschaften der Pfade von separablen Poisson-Prozessen, Zwischenankunftszeiten	1
5.4 Bemerkungen zum Pfad-Verhalten von separablen Wiener-Prozessen	11
Lösungen	19