

Reinhard Höpfner, SoSe20 , Uni Mainz

Literaturverzeichnis zur Vorlesung Stochastische Analysis

sukzessive aktualisiert

—

Update June 18, 2020

Bass, R.: Diffusions and elliptic operators. Springer 1997.

Beiglböck, M., Schachermayer, W., Veliyev, B.: A short proof of the Doob-Meyer theorem.
Stochastic Processes and their Applications **122**, 1204–1209 (2012).

Brémaud, P.: Point processes and queues. Springer 1981.

Dellacherie, C.: Capacités et processus stochastiques. Springer 1972.

Dellacherie, C., Meyer, P.:

Probabilités et potentiel (Französische Ausgabe)

Vol. I (Chapitres I–IV): Hermann 1975;

Vol. II (Chapitres V–VIII): Hermann 1980.

Probabilities and potential (Englische Ausgabe)

Vol. A (Chapters I–IV): North-Holland 1988.

Vol. B (Chapters V–VIII): North-Holland 1982.

Dieudonné, J.: Foundations of modern analysis. Academic Press 1969.

Heyer, H.: Einführung in die Theorie Markovscher Prozesse. Bibliograph. Inst. 1979.

Ikeda, N., Watanabe, S.: Stochastic differential equations and diffusion processes.
North-Holland / Kodansha 1989.

Jacod, J., Shiryaev, A.: Limit theorems for stochastic processes. Springer 1997.

Karatzas, J., Shreve, S.: Brownian motion and stochastic calculus. 2nd Ed. Springer 1991.

Kloeden, P., Platen, E.: Numerical solution of stochastic differential equations. Springer 1992.

Métivier, M.: Semimartingales. DeGruyter 1982.

Revuz, D., Yor, M.: Continuous martingales and Brownian motion. Springer 1991.