

Sommersemester 2004

Seminar zum Thema

Numerik Stochastischer Differentialgleichungen

Dr. Wesley Petersen & Dr. Andreas Prohl

Es werden aktuelle Arbeiten diskutiert, die sich mit der Konstruktion und Analyse numerischer Verfahren zur Lösung von SDE's befassen. Zusätzlich, wollen wir andere Themen zum Zusammenhang bringen: zB Wahrscheinlichkeitsmethode (via SDEs) für PDEs, und Funktionalintegralen (Wiener/Feynman). Diese Themen sind besonders für Theor. Physik geeignet

geeignet für Studierende und Doktoranden des D-MATH: Analysis, Numerik, Rechnergestützte Wissenschaften, Physik, Chemie, Ingenieurwissenschaften

Dozenten: W. Petersen, A. Prohl

Beginn: im Sommersemester 2004

Ort und Zeit: freitags, 11.00 – 12.00 in HG G59.2 (ETHZ)

Literatur: Originalarbeiten von D. Talay, P. Protter,...

Kontaktperson/-adresse: W. Petersen, HG G52.1 (wpp@math.ethz.ch), A. Prohl, HG G59.2 (apr@math.ethz.ch)