



Proseminar Stochastik im SS 2008

Donnerstag, 15.45 - 17.15 Uhr , S31

Markovsche Ketten bilden eine grundlegende und für Anwendungen sehr wichtige Klasse stochastischer Prozesse. Gegenstand des Proseminars sind Markovsche Ketten in diskreter Zeit und mit endlichem Zustandsraum. Nach der Diskussion der grundlegenden Definitionen und Eigenschaften werden u.a. stationäre Verteilungen, Ergodizitätseigenschaften, Reversibilität, Simulationsalgorithmen sowie perfekte Simulation behandelt. Auch konkrete Beispiele Markovscher Ketten sollen besprochen werden.

Voraussetzungen:

Die Vorlesungen „Stochastik I“, „Analysis I“ sowie „Lineare Algebra I“.

Literatur:

Häggström, Olle, Finite markov Chains and Algorithmic Applications, London Mathematical Society Student Texts, Volume 52, 2002.

Termin und Ort der Vorbesprechung: Dienstag, 5.Februar, 14 Uhr, Raum 143.

gez. Prof. Dr. Günter Last