

Seminar „Markovprozesse: Beispiele, Eigenschaften und Anwendungen“ WS 2010/11 (Prof. D. Becherer)

Scheinkriterien

- Handout für Teilnehmer, 1 – 2 Seiten
- Vortrag i.A. ca 60 min + Diskussion
- ggf. mit Unterstützung von Beamer/Overhead (für Latex wird empfohlen die „Beamer class“ zu benutzen), Hauptargument an der Tafel ausführen
- Vortragsausarbeitung
- Besprechung Ihrer Vortragsplanung etwa 10 Tage vorher
- regelmäßige Seminarteilnahme
- mind. eine Hauptreferenz zu Ihrem Thema ist angegeben, es ist vorteilhaft zudem ergänzende Literatur zu verwenden

Referenzen: siehe unten

Name, Vorname	Vortragsthemen	Ergänzend	Termin	Raum
Leitel, Sabine	N 1.1 – N 1.4		17.11.2010	Mi 13-15 Raum 3.008
Iotterand, Raphael	N 1.5 – N 1.6		17.11.2010	Mi 13-15 Raum 3.008
Preuß, Gabriel	N 1.7 – N 1.8		17.11.2010	Mi 15-17 Raum 4.007
Bauske, Kevin	N 1.9 –		17.11.2010	Mi 15-17 Raum 4.007
Wielart, Simone	N 2.1 – N 2.5	P B K KT	08.12.2010	Mi 13-15 Raum 3.008
Schütz, Pascal	N 2.6 – N 2.8	P B K KT	08.12.2010	Mi 13-15 Raum 3.008
Gallistl, Dietmar	N 3.1 – N 3.4	P B K KT	08.12.2010	Mi 15-17 Raum 4.007
Maxie, Robert	N 3.5 – N 3.6	P B K KT	12.01.2011! (60min)	Mi 15-17 Raum 4.007
Weidenhammer, Beate + Kalleske, Lena	MCMC: Metropolis/Hasting, Bspe + Simul.	B7 H3 H7 P3.1 K18.3 N5.5	12.01.2011 (ca 80min)	
Dao Thi, Lan	MCMC Konv.Raten	B7 H8 P3.3 K18.4	12.01.2011 (60min)	
Templin, Torsten + Gruber, Carolin	Opt.Control+ Simul.	N5.4, Z3 Z7, Ber voll	26.01.2011 (ca 80min)	
Bernhardt, Thomas	Kalman/Bucy Filter in disk. Zeit	Be, P5.4-5, BJ	26.01.2011 (60min)	

Weiter ab Mitte Jan.-Feb (2 Vorträge zu)	A) Kalman Filter in stetiger Zeit	Be1.2, Ka10 ,Ø6,	09.02.2011 (je ca 60min)
(2 Vorträge zu)	B) Diffusions-SDE Markoveig.+Martingalprobl.	KS5.4, RYchVII, K26	16.02.2011 (je ca 60min)
von den Teilnehmern:			
Laing, Hauke	B)		s.oben
Arnold, Dominic	A)		
Strampe, Christin	B)		“ “
Mbope, Achille“	A)		“ “

Referenzen

- N** = Norris, J.R. „*Markov Chains*“; Cambridge University Press
H = Häggström, O. „*Finite Markov Chains and Algorithmic Applications*“; Cambridge University Press
P = Pardoux, E. „*Markov Processes and Applications*“; Wiley
B = Brémaud, P. „*Markov Chains; Gibbs Fields, Monte Carlo Simulation, and Queues*“; Springer-Verlag
K = Klenke, A. „*Probability Theory: A Comprehensive Course*“; Universitext, Springer-Verlag
Ø = Øksendal, B. „*Stochastic Differential Equations*“, Universitext, Springer-Verlag
Be = Benoussan, A. „*Stochastic Control of Partially Observable Systems*“, Cambridge Press
Ber = Bertsekas, „*Dynamic Programming and Optimal Control*“, vol.1+2, Athena Scientific
KT = Karlin, S.; Taylor, H.M. „*A first/second Course in Stochastic Processes*“, Academic Press
Ka = Kallianpur, G. „*Stochastic Filtering Theory*“, Springer-Verlag
BJ = Bucy, R. S.; Joseph, P.D. „*Filtering for Stochastic Processes with Applications to Guidance*“, AMS Chelsea Publishing
RW = Rogers, L.C.G.; Williams, D. „*Diffusions, Markov Processes and Martingales*“, Vol. 1; Cambridge Mathematical Library
RY = Revuz, D; Yor, M. „*Continuous Martingales*“, 2005, Springer-Verlag
KS = Karatzas, I.; Shreve, S.E. „*Brownian Motion and Stochastic Calculus*“ Springer-Verlag
Z = Zabczyk, J. „*Chance and Decision -stoch. control in discrete time*“, Quaderni Pisa 1996