

**HUMBOLDT-UNIVERSITÄT ZU BERLIN**  
**MATHEM.-NATURWISS. FAKULTÄT II**  
**Institut für Mathematik**  
Bereich Stochastik  
D-10099 Berlin  
Unter den Linden 6



**Seminar „Markovprozesse: Beispiele, Eigenschaften und Anwendungen“  
im Wintersemester 2010/11**

Eine erste Vorbesprechung zum Seminar findet am Mittwoch, d. 20. Oktober 2010 um 13.15 Uhr im Raum 3.008 in der Rudower Chaussee 25 statt. Zeit und Raum kann sich in Absprache mit den Teilnehmern ändern.

Nach Rücksprache in der Vorbesprechung kann das Seminar gegebenenfalls als Blockveranstaltung stattfinden.

Teilnehmer sollten die Vorlesung „Stochastik II“ parallel hören oder über entsprechende Vorkenntnisse verfügen.

Literatur zur Orientierung über Seminarthemen:

- Pardoux, Etienne; *Markov Processes and Applications: Algorithms, Networks, Genome and Finance*, Wiley Series in Probability and Statistics
- Brémaud, Pierre; *Markov Chains; Gibbs Fields, Monte Carlo Simulation, and Queues*; Springer Verlag
- Norris, J.R.; *Markov Chains*; Cambridge University Press
- Häggström, Olle; *Finite Markov Chains and Algorithmic Applications*; Cambridge University Press
- Klenke, Achim; *Probability Theory: A Comprehensive Course*; Universitext, Springer Verlag