Technische Universität Berlin WS 2009/10

Fakultät II – Mathematik und Naturwissenschaften
Prof. Dr. Wolfgang König,
Matthias Steinrücken Stand: 17. Oktober 2009

Infoblatt

zur Vorlesung

Stochastische Modelle

Termine (s.t.):

Vorlesung:	Dienstag	8:30-10:00	MA 650	ab 13.10.09	Prof. Dr. Wolfgang König
	Donnerstag	8:30-10:00	MA 841	ab 15.10.09	Prof. Dr. Wolfgang König
Übung:	Donnerstag	10:15-11:45	MA 649	ab 15.10.09	Matthias Steinrücken

Personen:

		Büro	**Sprechzeit**	**Tel.**	**email**
Doz.	Prof. Dr. Wolfgang König	MA 770	nach Vereinb.	314 29383	`koenig@math.tu-berlin.de`
Ass.	Matthias Steinrücken	MA 780	Di 10:15-11:45	314 79394	`steinrue@math.tu-berlin.de`

Vorlesungen und Übungen: Die Veranstaltung besteht aus einer vierstündigen Vorlesung und einer zweistündigen Übung.

Inhalt: Markovketten in diskreter und kontinuierlicher Zeit, Warteschlangen, Stochastische Algorithmen, Poissonprozesse

Voraussetzungen: Die Hörer dieser Veranstaltung sollten die Grundvorlesungen *Analysis* und *Lineare Algebra* abgeschlossen haben und über Grundkenntnisse in Wahrscheinlichkeitstheorie verfügen, wie sie etwa die Vorlesung *Wahrscheinlichkeitstheorie I* vermittelt.

Hausaufgaben: Wöchentlich erscheint ein neues Übungsblatt mit Hausaufgaben auf der Homepage zur Vorlesung. Die Hausaufgaben werden in festen Gruppen bestehend aus maximal zwei Studierenden bearbeitet und abgegeben. Abgabetermin ist für alle Studierenden donnerstags um 8:25 s.t. vor der Vorlesung. Für einen Schein ist die Hälfte der Hausaufgabenpunkte zu erreichen.

Homepage zur Vorlesung:

`http://www.math.tu-berlin.de/Vorlesungen/WS09/StochMod/`

Literatur: Die Vorlesung orientiert sich zum Teil an Skripten von Herrn Prof. Dr. Wolfgang König, welche unter `http://www.math.uni-leipzig.de/~koenig/www/Skripte.html` zu finden sind. Markovketten in diskreter und kontinuierlicher Zeit werden im Skript "Stochastische Prozesse I" in Kapitel 2 und 3 behandelt. Der Vorlesungsteil zu stochastischen Algorithmen wird unter anderem die Themen aus Kapitel 5 und 6 des Skriptes "Stochastische Algorithmen" behandeln.