Fakultät Statistik - Kommentiertes Vorlesungsverzeichnis

Semester	Wintersemester 2017/18	
Titel der Veranstaltung	**Stochastische Prozesse in stetiger Zeit**	
Art der Veranstaltung	Vorlesung mit Übung (2V + 1Ü)	
Module	MS V "Stochastische Prozesse", MS VII "Spezialgebiete" MD V "Optimierung", MD IX + MD X "Anwendungen/Vertiefungen"	
Dozenten	Prof. Dr. Roland Fried (V) Dr. Alexander Dürre (Ü)	
zu erreichen	Raum M 213, Raum M 214	
Sprechstunde	nach Vereinbarung	
Zeit und Ort der Veranstaltung	Vorlesung: Montag 10.15-11.45 Uhr, M E27 Übung nach Vereinbarung	
Beginn	Mo, 09.10.2017, 10.15 Uhr	
Inhalt	Grundlegende stochastische Prozesse und deren Anwendung in der Statistik: Grundbegriffe der allgemeinen Theorie Poissonprozess und Warteschlangen Brownsche Bewegung, Brownsche Brücke und Strukturbruchtests Martingale	
Erforderliche Kenntnisse	Statistik I-III, Analysis I-II, Statistik V hilfreich	
Erwünschte Mitarbeit der Studierenden	• Aktive Teilnahme an Vorlesung und Übungen • Bearbeitung der Übungsaufgaben	
Leistungsnachweis (Art des Erwerbs)	Erfolgreiche Teilnahme über Übungen, Benoteter Leistungsnachweis über mündliche Prüfung Das Modul „Stochastische Prozesse“ erfordert eine Prüfung über 6SWS. Hierzu kann diese Veranstaltung mit der 2V+1Ü Veranstaltung „Stochastische Prozesse in diskreter Zeit“ aus dem vorigen Sommersemester kombiniert und gemeinsam geprüft werden.	
Liegt ein Skript vor?	ja	
Empfohlene Literatur	Wird in der Vorlesung bekannt gegeben	
Studiengänge	Statistik – Bachelor	
	Statistik – Master	x
	Datenanalyse und Datenmanagement – Bachelor	
	Datenwissenschaft – Master	x
Studienschwerpunkte	Biometrie	
	Technometrie	
	Ökonometrie	
	Amtliche Statistik	