

Vorlesungsankündigung für das WS 2010/11

Stochastische Methoden des Operations Research

TV 4 Di 08.15 – 09.45 Uhr B305
Do 08.15 – 09.45 Uhr F428
TU 2 Fr 08.15 – 09.45 Uhr A410

Inhalt:

Operations Research befasst sich mit der mathematischen Analyse technisch-wirtschaftlicher Systeme. Die Beschreibung von solchen Systemen, z.B. im Bereich der Risikotheorie, Bedienungstheorie, Zuverlässigkeitstheorie u.v.a.m., erfolgt vielfach durch geeignete stochastische Prozesse. Insbesondere sind in diesem Zusammenhang Markov-Ketten zu nennen. In dieser Vorlesung sollen nach Bereitstellung des notwendigen Rüstzeugs aus dem Bereich der mathematischen Stochastik verschiedene Anwendungen exemplarisch behandelt werden.

Vorkenntnisse:

Die Vorlesungen “Mathematische Stochastik I,II”; die Vorlesung “Mathematische Stochastik II” kann alternativ auch begleitend im jetzigen Wintersemester gehört werden.

Literatur:

Asmussen, S. (2003). *Applied Probability and Queues*. Springer, Berlin.
Brémaud, P. (1999). *Markov Chains, Gibbs Fields, Monte Carlo Simulation and Queues*. Springer, New York.

Beginn: Dienstag, 19. Oktober 2010