

Modulbeschreibung für Vertiefungsmodule des Wahlpflichtbereiches

Titel des Moduls	Simulationsbasierte Algorithmen für optimale Stoppprobleme.
In englischer Sprache	Simulation-based algorithms for optimal stopping problems

R	
A	X

	Vorlesung	Übung
Umfang	2 SWS	

Inhalt
<ol style="list-style-type: none"> 1. Erzeugung von gleichverteilten Pseudozufallszahlen 2. Transformationen von Zufallszahlen 3. Monte-Carlo-Methoden 4. elementare Einführung in stochastische Prozesse 5. Optimale Stoppprobleme 6. Simulation und Statistik stochastischer Prozesse 7. Empirische Prozesse 8. Konvergenzanalyse 9. Anwendungen in Versicherungs- und Finanzmathematik

Voraussetzungen	Stochastik I
------------------------	--------------

Regelsemester	--
----------------------	----

Abschluss	Mündliche Prüfung
------------------	-------------------

Prüfungszulassungsvoraussetzung	keine
--	-------

Studienpunkte	4
----------------------	---

R = Reine Mathematik
A = Angewandte Mathematik