

Modulbeschreibung für Vertiefungsmodule des Wahlpflichtbereiches

Titel des Moduls	Statistik Markovscher Prozesse
in englischer Sprache	Statistic of Markovian Processes

R	
A	X

	Vorlesung	Übung
Umfang	2	1

Inhalt	
<p>Stochastische Prozesse, Markov-Prozesse, Stationäre Verteilungen, Ergodizität Grenzverteilungen von Markovschen Ketten Dichte und Likelihood-Funktion von Markov-Ketten Die Maximum-Likelihood-Methode Der Likelihood-Quotienten-Test für einfache und zusammengesetzte Hypothesen Äquivalenz zum Chi-Quadrat-Test Der Likelihood-Quotienten-Test für Übergangswahrscheinlichkeiten Homogenitätstest Multiple Markov-Prozesse Einbettung von zeitstetigen Prozessen Martingalsätze</p>	

Voraussetzungen	Stochastik I (Einführung zu Statistik und Stoch. Prozessen wird bei Bedarf eingebunden)
------------------------	---

Regelsemester	Ab 5. Fachsemester
----------------------	--------------------

Abschluss	Prüfung
------------------	---------

Prüfungszulassungs- voraussetzung	keine
--	-------

Studienpunkte	5
----------------------	---

R = Reine Mathematik
 A = Angewandte Mathematik