

Prof. Dr. J. Woerner  
LS IV Stochastik

**BA-Seminar Stochastik**  
**WS 21/22**

Aufbauend auf Kenntnisse der Vorlesung Stochastik I werden wir ausgewählte Themen der stochastischen Simulation erarbeiten, u.a. direkte Simulation, Inversionsmethode und Markov-Chain Monte Carlo Algorithmen. Weiterhin werden wir dazu Beispiele aus der Physik und Finanzanwendungen betrachten.

**Literatur:**

T. Müller-Gronbach, E. Novak und K. Ritter, Monte Carlo-Algorithmen, Springer, 2012. (über die Bibliothek als ebook zugänglich)

**Vorbesprechung:** Mo 26.7.2021, 10:00 Uhr,  
<https://tu-dortmund.webex.com/meet/jeannette.woerner>