

Prof. Dr. J. Woerner
LS IV Stochastik

Seminar Stochastik
SS 21

Extremwerttheorie beschäftigt sich mit der Modellierung von extremen bzw. seltenen Ereignissen und deren Analyse, wobei eine wesentliche Rolle das asymptotische Verhalten von Maxima von Zufallsvariablen spielt. Klassische Anwendungen sind sowohl im Finanz- und Versicherungsbereich als auch bei Wetter-Phänomenen wie z.B. Hochwasser und Stürme.

Aufbauend auf Kenntnisse der Vorlesung Stochastik II werden wir ausgewählte Themenbereiche der Extremwerttheorie genauer erarbeiten.

Literatur:

L. de Haan, A. Ferreira, Extreme Value Theory: An Introduction, Springer, 2006.

Vorbesprechung: Di 16.2.2021, 11:00 Uhr,

<https://tu-dortmund.webex.com/meet/jeannette.woerner>