

Fakultät 6, Department Mathematik, Schwerpunkt Stochastik

Seminar über Stochastische Prozesse SoSe 2006, G. Hübner

Text: S. M. Ross, Introduction to Stochastic Dynamic Programming

Dat.		M		Kap, Seiten	Probl.	Topics
6.4.	1.		C.A.	I, 1 - 5	1-7?	Introd., First Examples
13.4.	2.		F.B.	5 - 11	8+9?	Monoton.+ Examples
20.4.	3.	M	K.S.	11 - 18	10+11?	Best Offer
27.4.	4.		O.M.	II, 29 - 33	1-7?	Disc.: OE+Opt.Policies
4.5.	5.		Y.L.	33 - 38	8+9?	Unique Sol., Succ.Appr.
11.5.	6.		Hü	38 - 44	10-13?	Pol.Improvem.+L.P.+...
18.5.	7.	M	M.B.	III, 49 - 57	1- 6?	Optimal Stopping
1.6.	9.	M	Y.L.	62 - 68	11-15?	Optimal Search
15.6.	10.	M	H.B.	IV, 73 - 83	1-7?	Applic.to Gambling
22.6.	11.		L.S.	V, 89 - 92	1-4?	Average Ret., Introd.
29.7.	12.		I.M.	93 - 98	5+6?	Ex. of Opt.Stat.Policies
6.7.	13.		R.K.	98 - 103	7-11?	Comput. Approaches
13.7.	14.	M	N.H.	VI,107 - 117	1-7?	Optimal Production

- Ablauf:** 1. Rechtzeitig Vortrag vorbereiten (s.u.)
2. Ausarbeitung ca. 10 Tage vorher abgeben (lesbare Handschrift reicht)
3. Kurzfassung (Gliederung, wichtige Definitionen und Sätze, hö. 2 Seiten)
für alle Teilnehmer, 1 Tag vorher abgeben oder selbst kopieren
4. Jeder Teilnehmer informiert sich vor dem Vortrag (kurz) über den Inhalt
(evtl. Fragen notieren)

Bemerkungen: Text sorgfältig (und rechtzeitig) durcharbeiten.
Definitionen, Behauptungen, Beweise, Bemerkungen unterscheiden.
Beweislücken zumindest erkennen und offenlegen.
Gut gliedern, insbesondere Beweise (Beweis-Schritte herausarbeiten)
Möglichst überall Motivationen und Interpretationen angeben.
Möglichst viel mit Beispielen und graphischen Darstellungen arbeiten.
Möglichst frei vortragen, ohne Blatt in der Hand, Beweise u.ä. an der Tafel.
Dies muß man auch schon mal vorher üben.
Vortragszeit ca. 75 Min. vorsehen und Kürzungsmöglichkeiten einplanen.