

Seminar ‚Lineare Algebra und Markovketten‘

Sommersemester 2014

Do 8 – 10, 04-422

Markovketten mit endlich vielen Zuständen können mit Hilfe von Methoden der linearen Algebra untersucht werden, um die Asymptotik der n -Schritt-Übergangswahrscheinlichkeiten zu beschreiben. Im Wesentlichen kommt es darauf an, Darstellungen der Matrix der 1-Schritt-Übergangswahrscheinlichkeiten und Eigenwerte vom Betrag 1 dieser Matrix zu untersuchen. Dies soll im Seminar anhand des Textes*

Fritz, Huppert, Willems
Stochastische Matrizen
Springer 1979

geschehen, der rein aus der Sicht der linearen Algebra geschrieben ist und keinerlei Vorkenntnisse aus der Stochastik voraussetzt.

Themenvergabe: **Donnerstag, 6.2.14, 12:00 Uhr, Raum 04-512**

Vorkenntnisse: Lineare Algebra

* Ein Exemplar ist als Kopiervorlage im Sekretariat Stochastik (Frau Grün), Raum 05-625, verfügbar.

Prof. Dr. R. Höpfner