

Spezielle Themen der Stochastik				Studiengang:	M
Modultyp:	ECTS-Punkte:	Workload:	Studiensemester:	Dauer des Moduls:	
Wahlpflicht	9 oder 5	270	1-4	Ein Semester	
Lehrveranstaltungen:			Kontaktzeit:	Selbststudium:	Geplante Gruppengröße:
Vorlesung (4 SWS)			60h	90h	25
Übungen (2 SWS)			30h	90h	25
oder			oder	oder	
Vorlesung (2 SWS)			30h	60h	25
Übungen (1 SWS)			15h	45h	25
Lernziele und Kompetenzen:					
Die Studierenden beherrschen ein spezielles Themengebiet der Stochastik.					
Inhalte:					
Themenbeispiele: (a) Zeitreihenanalyse (b) Finanzstochastik (c) Bayessche Statistik (d) Multiples Testen					
Sprache:					
Kursprache ist Deutsch.					
Lehrformen:					
Lehrvortrag (Tafel oder Beamer), Gruppenarbeit, Selbststudium.					
Verwendbarkeit des Moduls:					
M.Sc. Mathematik, M.Sc. Finanz- und Versicherungsmathematik					
Teilnahmevoraussetzungen:					
Zulassung zu einem der Masterstudiengänge „Mathematik“, „Finanz- und Versicherungsmathematik“					
Empfohlene Voraussetzungen:					
Die Lehrveranstaltung baut in der Regel auf eine vorangegangene Vorlesungsreihe des Dozenten auf.					
Prüfungsformen:					
mündliche Prüfung					
Prüfungsvorleistungen:					
Erfolgreiche Teilnahme an den Übungsgruppen					

Voraussetzungen für die Vergabe von ECTS-Punkten:

Erfolgreich abgelegte Modulabschlussprüfung. Eine Modulabschlussprüfung ist bestanden, wenn die Bewertung mindestens „ausreichend“ (4,0) lautet.

Häufigkeit des Angebots:

ca. alle 3 Semester

Stellenwert der Note für die Endnote:

Die Gesamtnote der Masterprüfung errechnet sich als mit den Leistungspunkten gewichtetes Mittel aus den Noten der Modulabschlussprüfungen sowie der Masterarbeit.

Modulbeauftragte und hauptamtlich Lehrende:

Bücher, Kern, Schwender

Sonstige Informationen:

Aktuelle Informationen auf den Internetseiten des Mathematischen Instituts (www.math.hhu.de).

Literatur:

- (a) P. Brockwell, R. Davis: Time series - theory and methods
- (b) A. Irle: Finanzmathematik
- (c) A. Gelman, J. Carlin, H. Stern: Bayesian data analysis
- (d) S. Dudoit, M. van der Laan: Multiple testing procedures with applications to genomics