

In der Reihe „Chemnitzer Mathematisches Colloquium“ der Fakultät für Mathematik der TU Chemnitz spricht

Herr Prof. Dr. Werner Römisch (Humboldt-Universität zu Berlin)

über das Thema

**Stochastische Optimierung, multivariate numerische Integration
und Quasi-Monte Carlo Methoden.**

Der Vortrag findet am

Donnerstag, dem 29. Juni 2017, um 16.00 Uhr, im Raum B202, Reichenhainer Straße 70

statt.

Ich möchte Sie hiermit recht herzlich zu dieser Veranstaltung einladen. Das Kolloquium wird von Herrn Prof. Dr. Alois Pichler geleitet.

Abstract:

Der Vortrag beginnt mit einer Einführung in zweistufige stochastische Optimierungsprobleme, der Charakterisierung ihrer Komplexität und einer Diskussion der Ursachen. Es folgt ein kurzer Überblick zu klassischen und neueren Komplexitäts-Resultaten für die multivariate Integration, der mit dem Traktabilitäts-Resultat in Tensor-Produkt Sobolev-Räumen und dessen Konsequenzen für die stochastische Optimierung endet. Der Vortrag endet mit einer kurzen Darstellung randomisierter Quasi-Monte Carlo Methoden und ihrem Potential für höherdimensionale numerische Integration und stochastische Optimierung.

Prof. Dr. Christoph Helmberg
Dekan

