

---

**Modulbezeichnung:** **Stochastische Prozesse (STOPRO)** **5 ECTS**  
 (Stochastic Processes)

Modulverantwortliche/r: Walter Kellermann  
 Lehrende: Walter Kellermann, Michael Günther

---

Startsemester: SS 2020	Dauer: 1 Semester	Turnus: jährlich (SS)
Präsenzzeit: 60 Std.	Eigenstudium: 90 Std.	Sprache: Deutsch

---

**Lehrveranstaltungen:**

Stochastische Prozesse (SS 2020, Vorlesung, 3 SWS, Walter Kellermann)  
 Ergänzungen und Übungen zu Stochastische Prozesse (SS 2020, Übung, 1 SWS, Michael Günther)  
 Tutorium zu Stochastische Prozesse (SS 2020, optional, Tutorium, 1 SWS, Michael Günther)

---

**Empfohlene Voraussetzungen:**

Vorlesung Signale und Systeme I & II

---

**Inhalt:**

**Wahrscheinlichkeitsrechnung und Zufallsvariablen**

Wahrscheinlichkeit, Zufallsvariablen, uni- und multivariate Wahrscheinlichkeitsverteilungen und - dichten; Funktionen von Zufallsvariablen und deren Verteilungen und - dichten; Erwartungswerte; spezielle Verteilungen (diskrete und kontinuierliche); Grenzwertsätze

**Stochastische Prozesse**

Verteilungen, Dichten und Erwartungswerte eindimensionaler Stochastischer Prozesse; Stationarität, Zyklstationarität, Ergodizität; Schwach stationäre, zeitkontinuierliche und zeitdiskrete Prozesse im Zeit- und Frequenzbereich; lineare zeitinvariante (LZI) Systeme und schwach stationäre Prozesse

**Schätztheorie**

Punkt- und Intervallschätzung; Schätzkriterien; Prädiktion; klassische und Bayes'sche Parameterschätzung (inkl. MMSE, Maximum Likelihood, Maximum A Posteriori); Cramer-Rao-Schranke; Hypothesentests und Entscheidungsverfahren (binäre Entscheidungen, Teststatistiken, Chi-Quadrat-Test); Binäre Entscheidungen, Neyman-Pearson-Kriterium

**Lineare Optimalfilterung**

Orthogonalitätsprinzip; zeitkontinuierliche und zeitdiskrete Wiener-Filterung; adaptive Filter (LMS, NLMS); zeitkontinuierliche und zeitdiskrete Signalangepasste Filter

**Lernziele und Kompetenzen:**

Die Studierenden

- analysieren die statistischen Eigenschaften von Zufallsvariablen und Stochastischen Prozessen mittels Wahrscheinlichkeitsdichten und Erwartungswerten
- verstehen die Unterschiede zwischen allgemeinen, stationären und ergodischen Prozessen
- kennen die spezielle Rolle der Gaußverteilung und ihre Auswirkungen auf die Eigenschaften von Zufallsvariablen und Prozesse
- analysieren die statistischen Eigenschaften von Zufallsprozessen am Ausgang von LZI-Systemen im Zeitbereich und im Frequenzbereich
- verstehen die Unterschiede klassischer und Bayes'scher Schätzung, entwerfen und analysieren MMSE- und ML-Schätzer für spezielle Schätzprobleme
- kennen elementare Hypothesentests und Entscheidungsverfahren
- analysieren Optimalfilterprobleme und wenden das Orthogonalitätsprinzip zur Ableitung optimaler Filter an
- verstehen und wenden das Konzept der signalangepassten Filterung an

**Literatur:**

Hänsler: Statistische Signale, Springer 1998;  
 Papoulis/Pillai: Probability, Random Variables, and Stochastic Processes, Prentice Hall, 2002

---

**Verwendbarkeit des Moduls / Einpassung in den Musterstudienplan:**

Das Modul ist im Kontext der folgenden Studienfächer/Vertiefungsrichtungen verwendbar:

**[1] Computational Engineering (Rechnergestütztes Ingenieurwesen) (Bachelor of Science)**

(Po-Vers. 2010 | TechFak | Computational Engineering (Rechnergestütztes Ingenieurwesen) (Bachelor of Science)  
| Gesamtkonto | Technische Wahlmodule | Stochastische Prozesse)

Dieses Modul ist daneben auch in den Studienfächern "123#67#H", "Computational Engineering (Rechnergestütztes Ingenieurwesen) (Master of Science)", "Elektrotechnik, Elektronik und Informationstechnik (Bachelor of Science)", "Informations- und Kommunikationstechnik (Bachelor of Science)", "Wirtschaftsingenieurwesen (Bachelor of Science)" verwendbar.

---

**Studien-/Prüfungsleistungen:**

Stochastische Prozesse (Prüfungsnummer: 35801)

(englische Bezeichnung: Stochastic Processes)

Prüfungsleistung, Klausur, Dauer (in Minuten): 90

Anteil an der Berechnung der Modulnote: 100%

weitere Erläuterungen:

Durch Abgabe der Übungsblätter können Bonuspunkte für die Klausur erarbeitet werden. Wird die Klausur ohne Bonus nicht bestanden, darf der Bonus nicht angerechnet werden. Der Bonus verfällt dann auch für die Wiederholungsklausur. Es gilt folgende Abbildung (bei 100 erreichbaren Punkten in der Klausur): 1 bestandenes Übungsblatt = 1 Bonuspunkt in der Klausur, 2 bestandene Übungsblätter = 2 Bonuspunkte in der Klausur, 3 bestandene Übungsblätter = 3 Bonuspunkte in der Klausur, 4 bestandene Übungsblätter = 4 Bonuspunkte in der Klausur, 5 bestandene Übungsblätter = 5 Bonuspunkte in der Klausur.

Erstablingung: SS 2020, 1. Wdh.: WS 2020/2021

1. Prüfer: Walter Kellermann

---

**Organisatorisches:**

Signale und Systeme I u. II, bzw. Systemtheorie