

Stochastische Simulation, SS 2006: Literaturverzeichnis

Allgemeine Bücher über stochastische Simulation

1. G. S. Fishman. Monte Carlo: Concepts, Algorithms and Applications. Springer 1999 (3. Auflage).
2. J. E. Gentle. Random Number Generation and Monte Carlo Methods. Springer 2003 (2., erweiterte Auflage).
3. P. Glasserman, Monte Carlo Methods in Financial Engineering. Springer 2004.
4. J. S. Liu, Monte Carlo Strategies in Scientific Computing. Springer 2001.
5. B. D. Ripley. Stochastic Simulation. Wiley, 1987.
6. Ch. Robert, G. Casella. Monte Carlo Statistical Methods. Springer 2004 (2. erweiterte Auflage).
7. S. M. Ross. Simulation, 2. Auflage. Academic Press, 1997.

Nr. 5 und 6 sind ähnlich wie die Vorlesung. Nr. 7 ist sehr elementar. Nr. 3. Nr. 4 enthält den wesentlichen Stoff der Kapitel 2 und 3, ein sehr lesbares Kapitel über Quasi Monte Carlo und daneben noch sehr viel über Finanzmathematik. Nr. 4 ist eher fortgeschritten.

Bücher zu spezielleren Themen

1. L. Devroye. Non-uniform Random Variate Generation. Springer, 1986.
2. K. T. Fang, Y. Wang. Number-Theoretic Methods in Statistics. Chapman & Hall, 1994. (zu Quasi Monte Carlo)
3. W. R. Gilks, S. Richardson, D. J. Spiegelhalter. Markov Chain Monte Carlo in Practice. Chapman & Hall, 1996.
4. P. J. Green. A Primer on Markov Chain Monte Carlo. In: Complex Stochastic Systems, O.E. Barndorff-Nielsen, D. R. Cox und C. Klüppelberg, eds.. Chapman & Hall/CRC, 2001.
5. R. Motwani , P. Raghavan. Randomized Algorithms. Cambridge University Press, 1995.
6. H. Niederreiter. Random Number Generation and Quasi-Monte Carlo Methods. SIAM, 1992. (zu Quasi Monte Carlo).

6. 7. 2006, H.R. Künsch