



**TÁJÉKOZTATÓ A BME
TERMÉSZETTUDOMÁNYI KARÁRA
ALKALMAZOTT MATEMATIKUS
MESTERSZAKRA
FELVÉTELT NYERT
HALLGATÓK SZÁMÁRA**



2016

Tartalomjegyzék

1. Dékáni köszöntő
2. Tájékoztató az Alkalmazott matematikus mesterképzésről
3. Az Alkalmazott matematikus mesterképzési szak mintatanterve
4. Tantárgyi programok
5. A Természettudományi Kar Dékáni Hivatala és Hallgatói Képvisellete
6. A Természettudományi Kar intézetei és tanszékei

Kedves Alkalmazott Matematikus Hallgató!

Szeretettel köszöntöm abból az alkalomból, hogy a Budapesti Műszaki és Gazdaságtudományi Egyetem (BME vagy népszerű nevén a Műegyetem) polgára lett. Külön örülök annak, hogy tanulmányaihoz a Természettudományi Kart választotta, hiszen hosszú évek óta nagy hangsúlyt fektetünk arra, hogy a tőlünk kikerülő hallgatók világszínvonalú tudással bárhol megállják a helyüket és itthon vagy akár külföldön öregbítsék országunk jó hírét. Nemzetközi hírű professzorainkkal, kutatásban és oktatásban kiterjedt tapasztalatokkal rendelkező tanártársaimmal arra törekszünk, hogy Önnel együttműködve, közös erőfeszítéssel, a tudása mélyüljön, látóköre szélesedjen és képzése során sok hasznos ismeretre tegyen szert. A karhoz tartozó oktatási egységek igen sok külföldi egyetemmel alakítottak ki élénk és nagyon eredményes oktatási és kutatási együttműködést. Ennek révén a magasabb évfolyamos hallgatók egy részének lehetőséget nyújtunk arra, hogy tanulmányaik bizonyos szakaszát külföldi egyetemeken folytathassák.

Célunk, hogy amikor majd kézhez veszi MSc diplomáját, az elhelyezkedés ne jelenthessen gondot és olyan munkát választhasson, ami nemcsak biztos megélhetést nyújt, hanem érdeklődésének megfelelő is.

Az Alkalmazott matematikus mesterképzés még viszonylag új a Műegyetemen, de a korábbi osztatlan képzésben, matematikus szakunkon a kilencvenes évek közepe óta folyik képzés a Természettudományi Karon, kiváló eredménnyel. Eddigi tapasztalataink szerint a hallgatóink érdeklődőek és teljesítményorientáltak. Kívánjuk, hogy minél inkább járuljon hozzá ahhoz, hogy hallgatótársai között kialakuljon az egymást segítés és egymással versengés egyensúlya.

Az egyetemi évek mindenki életében meghatározóak, nemcsak a megszerzett ismeretanyag tekintetében – hiszen manapság a tanulás egy életre szóló program –, hanem az egyetemi életben való részvétel, az itt létrejövő személyes kapcsolatok és az itt kialakuló tudományos szemlélet miatt is. Arra biztatom, hogy használja ki jól a BME nyújtotta lehetőségeket! Tájékozódjék, keresse a kapcsolatokat a felsőbb éves hallgatókkal, professzoraival és tanáraival! Nem fog csalódni, ha esetleges problémáival hozzájuk fordul.

Most azonban nem a problémák, hanem az öröm perceit éljük: örülünk, hogy csatlakozott hozzánk, a felvételéhez szívből gratulálók!

DR. PIPEK JÁNOS
dékán

TÁJÉKOZTATÓ AZ ALKALMAZOTT MATEMATIKUS MESTERKÉPZÉSÉRŐL

Miért ajánljuk a Műegyetem Alkalmazott matematikus képzését?

A világ rangos műszaki egyetemeinek gyakorlatát követve és saját jó hagyományát felelevenítve, a Műegyetem Természet- és Társadalomtudományi Kara – az 1998-ban alakult Természettudományi Kar jogelődje – 1997-ben beindította a matematikus képzést. A képzést a Kar Matematika Intézete gondozza.

Olyan szakembereket képzünk, akik érzékenyek a gyakorlati problémák iránt és képesek alkotó módon felhasználni ismereteiket; akik, amellet, hogy a matematika elvont területein otthonosan mozognak, kommunikálni és együttműködni tudnak más szakmák képviselőivel is. Az egyesült Európához tartozó, fejlődő magyar gazdaságnak nagy szüksége van ilyen szakemberekre.

Matematikus képzésünk szervesen illeszkedik a BME-n folyó alkalmazás-orientált tudományos képzés széles spektrumába, mely a klasszikus mérnökképzés mellett felölel olyan matematikaigényes új területeket is, mint az informatika, közgazdaságtudomány, anyagtudomány, gazdasági tervezéselemzés, műszaki management, rendszerelmélet stb.

A matematikai **modellalkotás** és **elemzés** egyre inkább szerves részét képezi a műszaki, gazdasági és természettudományos tevékenység kreatív ágainak. E tevékenység jól képzett, invenciózus, mozgékony elméjű fiatal matematikusokat igényel. Az ilyen szakemberek iránti társadalmi igény látványosan növekszik.

A képzést döntően a Budapesti Műszaki és Gazdaságtudományi Egyetem Természettudományi Karának Matematika Intézete fogja tartani, amely a következő 5 tanszékből áll: Algebra Tanszék, Analízis Tanszék, Differenciálegyenletek Tanszék, Geometria Tanszék, Sztochasztika Tanszék.

A szak oktatásában a Matematika Intézet együttműködik a Villamosmérnöki és Informatikai Kar Számítástudományi és Információelméleti Tanszékével. A fent említett tanszékek a nevüknek megfelelő tudományterületek szerint szerveződtek. A legtöbb tanszék élén nemzetközileg is elismert, kimagasló tudományos teljesítményt nyújtó professzorok állnak. A vezetésük alatt álló tanszéken folyó kutatási munka a hazai és nemzetközi tudományos élet elismert központja. Kitűnő, és az utóbbi időben kétoldalú együttműködési szerződéssel szabályozott oktatási és kutatási kapcsolataink vannak a hozzánk tematikusan közel álló akadémiai intézetekkel (MTA Rényi Intézet, MTA SZTAKI).

A bolognai rendszerre való áttéréskor nagy hangsúlyt helyeztünk arra, hogy az osztatlan képzésben elért eredményeinket, jól bevált tantárgyainkat megőrizzük, és eközben kihasználjuk az új, többciklusú oktatási rendszer előnyeit is. Azokat az alapképzést befejező tehetséges hallgatókat várjuk az **alkalmazott matematikus mesterszakra**, akik nagy elhivatottságot éreznek a matematika művelése iránt.

Az **alkalmazott matematikus mesterszak** keretében igyekesünk kihasználni a Műegyetem adta lehetőségeket, hogy hallgatóink betekintést nyerjenek a műszaki és gazdasági alkalmazásokba. Erre szolgálnak például olyan tárgyaink, mint a *Témalabor*, a *Matematikai modellalkotás* stb. A BME-n természetesen adott az a tudományos és alkalmazási háttér, mely az alkalmazott matematikus szakhoz alapvetően szükséges. A képzésen belül az **Alkalmazott analízis**, az **Operációkutatás**, a **Pénzügy-matematika** és a **Sztochasztika** specializációkat lehet választani.

A szakra vonatkozó szabályozásokat (pl. a záróvizsga letételének feltételeit, a diplomamunka elkészítését) a szak **tanrendje** tartalmazza. Az ütemes előrehaladás garanciája, ha a hallgatók a **min-tanterv** szerint veszik fel a tantárgyakat. Az egyes tantárgyak felvételéhez szükséges kötelező előismereteket az **előtanulmányi rend** tartalmazza. *Felhívjuk a figyelmet, hogy a következő információk tájékoztató jellegűek.* Kiseb kiigazító módosítások, kiegészítések a Hallgatói Képviselő, a Matematikus Szakbizottság és a Kari Tanács egyetértésével a tanulmányok során előfordulhatnak. A dokumentumok mindenkor aktuális változata a kar honlapján, a <http://www.ttk.bme.hu> címen olvasható.

AZ ALKALMAZOTT MATEMATIKUS MESTERKÉPZÉSI SZAK MINTATANTERVE

ALKALMAZOTT ANALÍZIS SPECIALIZÁCIÓ					kontakt óra per hét / kredit / vizsgák
	I.	II.	III.	IV.	
Elméleti alapozás	12/14/2v	4/6/1v	0/0/0v	0/0/0v	16/20/3v
<i>Az elméleti alapozás tárgyai a Matematika BSc szak kötelező tárgyai közül kerülhetnek ki. Ebből azoknak a hallgatóknak kell szükség és oktatói előírás szerint maximum 20 kreditnyit kell teljesítenie, akik nem a Matematika BSc szakon szerzett diplomával nyernék felvételt. Azok a hallgatók, akiknek az alapozó tárgyakból 20-nál kevesebb kreditnyi teljesíteni valójuk van, a fennmaradó kredit-keretet választható szakmai tárgyakkal töltik ki.</i>					
Szakmai törzsanyag	4/5/1v	8/10/1v	8/10/1v	4/5/0v	24/30/3v
<i>Az alábbi 12 tárgyból legalább 6-ot kell teljesíteni. A tárgyakat oly módon kell kiválasztani, hogy az Algoritmuselmélet [1], Alkalmazott analízis [2], Diszkrét matematika [3], Operációkutatás [4], Sztochasztika [5] tematikus csoportok közül 4-et lefedjenek. A *-gal megjelölt tárgyakat az Alkalmazott analízis specializáció hallgatóinak kötelezően fel kell venniük.</i>					
Globális optimalizálás [1, 4]		3/1/0/f/5			
Lineáris programozás [1, 4]	3/1/0/v/5				
Elméleti számítástudomány [1, 3]				3/1/0/f/5	
Algebrai és általános kombinatorika [3]			3/1/0/v/5		
Dinamikai rendszerek* [2]				3/1/0/v/5	
Fourier analízis és függvénysorok* [2]			3/1/0/v/5		
Parciális differenciálegyenletek 2* [2]				3/1/0/f/5	
Sztochasztikus analízis és alkalmazásai [5]	3/1/0/v/5				
Statisztika és információelmélet [5]				3/1/0/f/5	
Kommutatív algebra és algebrai geometria	3/1/0/f/5				
Reprezentáció elmélet		3/1/0/f/5			
Differenciálgeometria és topológia			3/1/0/v/5		
A specializáció tárgyai	10/10/1v	8/9/1v	10/11/2v	8/10/2v	36/40/6v
<i>A **-gal és ***-gal megjelölt tárgyakból a specializáció hallgatóinak egyet-egyet kell felvenniük.</i>					
Matematikai perkolációelmélet ***		2/0/0/f/3			
A klasszikus mechanika matematikai módszerei				2/0/0/f/2	
Numerikus módszerek 2 – Parciális differenciálegyenletek		2/0/2/v/5			
Vektorterek a fizikában			2/0/0/f/2		
Mátrixanalízis	2/0/0/v/3				
Matematikai kémia**		2/0/2/v/5			
Operátorelmélet			3/1/0/v/5		
Potenciálmélet***		2/0/0/f/3			
Inverz szórási feladatok	2/0/0/v/3				
A klasszikus mezőelméletek geometriája			2/0/0/f/2		
A statisztikus fizika matematikai módszerei				2/0/0/v/3	
Disztribúcióelmélet és Green-függvények		2/0/0/v/2			
Egyéb tárgyak					
Témalabor 1, 2		0/0/4/f/4	0/0/4/f/4		
Matematikai modellalkotás 1, 2	2/0/0/f/1		2/0/0/f/1		
Választható tárgyak	0/0/0v	5/5/1v	5/5/1v	0/0/0v	10/10/2v
Szabadon választható szakmai tárgyak		3/0/0/v/3	3/0/0/v/3 2/0/0/f/2		
Kötelezően választható társadalomtudományi vagy gazdaságtudományi tárgy		2/0/0/f/2			
Diplomamunka	0/0/0v	0/0/0v	2/5/0v	8/15/1v	10/20/1v
Beszámoló		0/0/0/a/0			
Diplomamunka előkészítés			0/2/0/f/5		
Diplomamunka-készítés				0/8/0/v/15	
ÖSSZESEN óra / kredit / vizsgák száma	26/29/ 4v	25/30/ 4v	25/31/ 4v	20/30/ 3v	96/120/ 15v

A tárgyak paraméterei: előadás / gyakorlat / labor / vizsga (v) vagy félévközi jegy (f) / kredit.

OPERÁCIÓKUTATÁS SPECIALIZÁCIÓ					kontakt óra per hét / kre- dit / vizsgák
	I.	II.	III.	IV.	
Elméleti alapoás	12/14/1v	4/6/1v	0/0/0v	0/0/0v	16/20/2v
<i>Az elméleti alapoás tárgyai a Matematika BSc szak kötelező tárgyai közül kerülhetnek ki. Ebből azoknak a hallgatóknak kell szükség és oktatói előírás szerint maximum 20 kreditnyit kell teljesítenie, akik nem a Matematika BSc szakon szerzett diplomával nyernék felvételt. Azok a hallgatók, akiknek az alapoó tárgykból 20-nál kevesebb kreditnyi teljesíteni valójuk van, a fennmaradó kredit-keretet választható szakmai tárgyakkal töltik ki.</i>					
Szakmai törzsanyag	4/5/1v	8/10/1v	8/10/2v	4/5/0v	24/30/4v
<i>Az alábbi 12 tárgyból legalább 6-ot kell teljesíteni. A tárgyakat oly módon kell kiválasztani, hogy az Algoritmuselmélet [1], Alkalmazott analízis [2], Diszkrét matematika [3], Operációkutatás [4], Sztochasztika [5] tematikus csoportok közül 4-et lefedjenek. A *-gal megjelölt tárgyakat az Operációkutatás specializáció hallgatóinak kötelezően fel kell venniük.</i>					
Globális optimalizálás* [1, 4]		3/1/0/f/5			
Lineáris programozás* [1, 4]	3/1/0/v/5				
Elméleti számítástudomány [1, 3]				3/1/0/f/5	
Algebrai és általános kombinatorika [3]			3/1/0/v/5		
Dinamikai rendszerek [2]				3/1/0/v/5	
Fourier analízis és függvényesorok [2]			3/1/0/v/5		
Parciális differenciálegyenletek 2 [2]				3/1/0/f/5	
Sztochasztikus analízis és alkalmazásai [5]	3/1/0/v/5				
Statisztika és információelmélet* [5]				3/1/0/f/5	
Kommutatív algebra és algebrai geometria	3/1/0/f/5				
Reprezentáció elmélet		3/1/0/f/5			
Differenciálgeometria és topológia			3/1/0/v/5		
A specializáció tárgyai	10/11/1v	8/9/1v	10/10/1v	8/10/2v	36/40/5v
Nemlineáris programozás		3/1/0/v/5			
Kombinatorikus optimalizálás		3/1/0/v/5			
Sztochasztikus programozás				3/1/0/v/5	
Operációkutatási programrendszerek	0/0/2/f/2				
Irányítási rendszerek	2/0/0/v/3				
Bevezetés a közgazdasági dinamikába			3/1/0/v/5		
Játékelmélet			2/0/0/f/3		
Ökonometria			0/0/2/f/2		
Egyéb tárgyak					
Témalabor 1, 2		0/0/4/f/4	0/0/4/f/4		
Matematikai modellalkotás 1, 2	2/0/0/f/1		2/0/0/f/1		
Választható tárgyak	0/0/0v	5/5/1v	5/5/1v	0/0/0v	10/10/2v
Szabadon választható szakmai tárgyak		3/0/0/v/3	3/0/0/v/3 2/0/0/f/2		
Kötelezően választható társadalomtudományi vagy gazdaságtudományi tárgy		2/0/0/f/2			
Diplomamunka	0/0/0v	0/0/0v	2/5/0v	8/15/1v	10/20/1v
Beszámoló		0/0/0/a/0			
Diplomamunka előkészítés			0/2/0/f/5		
Diplomamunka-készítés				0/8/0/v/15	
ÖSSZESEN	26/30/	25/30/	25/30/	20/30/	96/120/
óra / kredit / vizsgák száma	3v	4v	4v	3v	14v

A tárgyak paraméterei: előadás / gyakorlat / labor / vizsga (v) vagy félévközi jegy (f) / kredit.

PÉNZÜGY-MATEMATIKA SPECIALIZÁCIÓ ANGOL NYELVEN					kontakt óra per hét / kredit / vizsgák
	I.	II.	III.	IV.	
Elméleti alapozás	10/10/1v	4/6/1v	0/0/0v	0/0/0v	14/16/2v
<i>Az elméleti alapozás tárgyai a Matematika BSc szak kötelező tárgyai közül kerülhetnek ki. Ebből azoknak a hallgatóknak kell szükség és oktatói előírás szerint maximum 20 kreditnyit kell teljesítenie, akik nem a Matematika BSc szakon szerzett diplomával nyernek felvételt. Azok a hallgatók, akiknek az alapozó tárgyakból 20-nál kevesebb kreditnyi teljesíteni valójuk van, a fennmaradó kredit-keretet választható szakmai tárgyakkal töltik ki.</i>					
Szakmai törzsanyag	4/5/1v	8/10/0v	8/10/2v	4/5/0v	24/30/3v
<i>Az alábbi 12 tárgyból legalább 6-ot kell teljesíteni. A tárgyakat oly módon kell kiválasztani, hogy az Algoritmuselmélet [1], Alkalmazott analízis [2], Diszkrét matematika [3], Operációkutatás [4], Sztochasztika [5] tematikus csoportok közül 4-et lefedjenek. A *-gal megjelölt tárgyakat a Pénzügy-matematika specializáció hallgatóinak kötelezően fel kell venniük.</i>					
Globális optimalizálás [1, 4]		3/1/0/f/5			
Lineáris programozás* [1, 4]	3/1/0/v/5				
Elméleti számítástudomány [1, 3]				3/1/0/f/5	
Algebrai és általános kombinatorika [3]			3/1/0/v/5		
Dinamikai rendszerek [2]				3/1/0/v/5	
Fourier analízis és függvénysorok [2]			3/1/0/v/5		
Parciális differenciálegyenletek 2 [2]				3/1/0/f/5	
Sztochasztikus analízis és alkalmazásai* [5]	3/1/0/v/5				
Statisztika és információelmélet* [5]				3/1/0/f/5	
Kommutatív algebra és algebrai geometria	3/1/0/f/5				
Reprezentáció elmélet		3/1/0/f/5			
Differenciálgeometria és topológia			3/1/0/v/5		
A specializáció tárgyai	12/14/2v	8/9/1v	12/13/1v	8/10/1v	40/46/5v
Statisztika					
Nemparaméteres statisztika			2/0/0/v/3		
Statisztikai programcsomagok 2			0/0/2/f/2		
Biostatisztika			0/2/0/f/3		
Sztochasztikus rendszerek					
Markov folyamatok és martingálok	3/1/0/v/5				
Sztochasztikus differenciálegyenletek		3/1/0/v/5			
Pénzügyi folyamatok		2/0/0/f/3			
Dinamikus programozás a pénzügyi matematikában			2/0/0/v/3		
Gazdaságtudományok					
Extrémérték elmélet				2/0/0/v/3	
Biztosítás matematika 2		2/0/0/f/2			
Többváltozós statisztika gazdasági alkalmazásokkal			2/0/0/f/2		
Közgazdasági idősorok elemzése				2/0/0/f/2	
Idősorelemzések pénzügyi alkalmazásokkal	2/0/0/f/3				
Egyéb					
Témalabor 1, 2		0/0/4/f/4	0/0/4/f/4		
Matematikai modellalkotás 1, 2	2/0/0/f/1		2/0/0/f/1		
Választható tárgyak	0/0/0v	5/5/1v	2/3/0v	0/0/0v	7/8/1v
Szabadon választható szakmai tárgyak		3/0/0/v/3	2/0/0/f/3		
Kötelezően választható társadalomtudományi vagy gazdaságtudományi tárgy		2/0/0/f/2			
Diplomamunka	0/0/0v	0/0/0v	2/5/0v	8/15/1v	10/20/1v
Beszámoló		0/0/0/a/0			
Diplomamunka előkészítés			0/2/0/f/5		
Diplomamunka-készítés				0/8/0/v/15	
ÖSSZESEN óra / kredit / vizsgák száma	26/29/ 4v	25/30/ 3v	24/31/ 3v	20/30/ 2v	96/120/ 12v

A tárgyak paraméterei: előadás / gyakorlat / labor / vizsga (v) vagy félévközi jegy (f) / kredit.

SZTOCHASZTIKA SPECIALIZÁCIÓ ANGOL NYELVEN					kontakt óra per hét / kredit / vizsgák
	I.	II.	III.	IV.	
Elméleti alapozás	12/14/1v	4/6/1v	0/0/0v	0/0/0v	16/20/2v
Az elméleti alapozás tárgyai a Matematika BSc szak kötelező tárgyai közül kerülhetnek ki. Ebből azoknak a hallgatóknak kell szükség és oktatói előírás szerint maximum 20 kreditnyit kell teljesítenie, akik nem a Matematika BSc szakon szerzett diplomával nyernek felvételt. Azok a hallgatók, akiknek az alapozó tárgyakból 20-nál kevesebb kreditnyi teljesíteni valójuk van, a fennmaradó kredit-keretet választható szakmai tárgyakkal töltik ki.					
Szakmai törzsanyag	4/5/0v	8/10/0v	4/10/1v	4/5/0v	24/30/1v
Az alábbi 12 tárgyból legalább 6-ot kell teljesíteni. A tárgyakat oly módon kell kiválasztani, hogy az Algoritmuselmélet [1], Alkalmazott analízis [2], Diszkrét matematika [3], Operációkutatás [4], Sztochasztika [5] tematikus csoportok közül 4-et lefedjenek. A *-gal megjelölt tárgyakat a Sztochasztika specializáció hallgatóinak kötelezően fel kell venniük.					
Globális optimalizálás [1, 4]		3/1/0/f/5			
Lineáris programozás [1, 4]	3/1/0/v/5				
Elméleti számítástudomány [1, 3]				3/1/0/f/5	
Algebrai és általános kombinatorika [3]			3/1/0/v/5		
Dinamikai rendszerek [2]				3/1/0/v/5	
Fourier analízis és függvénysorok [2]			3/1/0/v/5		
Parciális differenciálegyenletek 2* [2]				3/1/0/f/5	
Sztochasztikus analízis és alkalmazásai* [5]	3/1/0/v/5				
Statisztika és információelmélet* [5]				3/1/0/f/5	
Kommutatív algebra és algebrai geometria	3/1/0/f/5				
Reprezentáció elmélet		3/1/0/f/5			
Differenciálgeometria és topológia			3/1/0/v/5		
A specializáció tárgyai	10/11/2v	8/9/1v	10/10/1v	8/10/1v	36/40/5v
Statisztika					
Többváltozós statisztika.			3/1/0/v/5		
Nemparaméteres statisztika			2/0/0/v/3		
Statisztikai programcsomagok 2			0/0/2/f/2		
Sztochasztikus analízis					
Markov-folyamatok és martingálok	3/1/0/v/5				
Sztochasztikus differenciálegyenletek		3/1/0/v/5			
Pénzügyi folyamatok		2/0/0/f/3			
Egyéb					
A **-gal megjelölt két tárgyból a specializációhallgatóinak egyet kell felvenniük.					
Határeloszlás- és nagy eltérés tételek				3/1/0/v/5	
Sztochasztikus modellek**		2/0/0/f/2			
Haladó dinamikai rendszerek**		2/0/0/f/2			
Témalabor 1, 2		0/0/4/f/4	0/0/4/f/4		
Matematikai modellalkotás 1, 2	2/0/0/f/1		2/0/0/f/1		
Választható tárgyak	0/0/0v	5/5/1v	5/5/1v	0/0/0v	10/10/2v
Szabadon választható szakmai tárgyak		3/0/0/v/3	3/0/0/v/3 2/0/0/f/2		
Kötelezően választható társadalomtudományi vagy gazdaságtudományi tárgy		2/0/0/f/2			
Diplomamunka	0/0/0v	0/0/0v	2/5/0v	8/15/1v	10/20/1v
Beszámoló		0/0/0/a/0			
Diplomamunka előkészítés			0/2/0/f/5		
Diplomamunka-készítés				0/8/0/v/15	
ÖSSZESEN	26/30/	25/30/	25/30/	20/30/	96/120/
óra / kredit / vizsgák száma	3v	3v	3v	2v	11v

A tárgyak paraméterei: előadás / gyakorlat / labor / vizsga (v) vagy félévközi jegy (f) / kredit.

TANTÁRGYI PROGRAMOK

Szakmai törzsanyag

Kommutatív algebra és algebrai geometria, BMETE91MM01, 3/1/0/f/5

Zárt algebrai halmazok és koordinátagyűrűk, morfizmusok, irreducibilitás, dimenzió, Hilbert-féle Nullstellensatz, radikálideálok és részvarietások közti megfeleltetés. Monomiális rendezések, Gröbner-bázisok, Buchberger-algoritmus, számítások polinomgyűrűkben. Reguláris függvényektől a racionális leképezésekig, lokális gyűrű, kékvek alapfogalmai, gyűrűzött terek. Projektív tér és részvarietásai, homogén koordinátagyűrű, morfizmusok, projektív varietás képe zárt. Geometriai konstrukciók: Segre- és Veronese-leképezések, Grassmann-varietások, pontból történő vetítés, fel-fújás. Affin és projektív varietások dimenziója, hiperfelületek. Sima varietások, Zariski-érintőtér, Jacobi-feltétel. Hilbert-polinom és Hilbert-függvény, példák, számítógépes kísérletek. Gyűrűk és modulusok alapfogalmai, láncfeltételek, szabad modulusok. Végesen generált modulusok, Cayley–Hamilton-tétel, Nakayama-lemma. Lokalizáció és tenzorszorzat. Modulusok szabad feloldásai, modulusok Gröbner-elmélete, számítások modulusokkal, a Hilbert-féle kapcsolat-tétel.

Irodalom:

Andreas Gathmann: A. Gathmann, Algebraic geometry, notes for a one-year course taught in the Mathematics International program at the University of Kaiserslautern (2003), <http://www.mathematik.uni-kl.de/~gathmann/en/pub.html>
I.R. Shafarevich: Basic Algebraic Geometry I.-II., Springer Verlag (1995)
Miles Reid: Undergraduate Commutative Algebra, Cambridge University Press (1996)
Robin Hartshorne: Algebraic Geometry, Springer Verlag (1977)
M.F. Atiyah, I.G. Macdonald: Introduction to commutative algebra, Addison Wesley Publishing (1994)

Dinamikai rendszerek, BMETE93MM02, 3/1/0/v/5

Folytonos és diszkrét idejű dinamikai rendszerek, folytonos versus diszkrét: követőfüggvény, diszkrétizáció. Egyensúlyi helyzetek lokális elmélete: Grobman–Hartman lemma, stabil-instabil-centrális sokaság, Poincaré normálforma. Attraktorok, Ljapunov-függvények, LaSalle-elv, fázis-portré. Strukturális stabilitás, egyensúlyi helyzetek/fixpontok és periodikus megoldások elemi bifurkációi, bifurkációs görbék biológiai modellekben. Sátor és logaritmusos függvények, Smale-patkó, szolenoid: topológiai, kombinatorikus, mértékelméleti tulajdonságok. Káosz a Lorenz-modellben.

Irodalom:

P. Glendinning: Stability, Instability and Chaos, Cambridge University Press, Cambridge, 1994
C. Robinson: Dynamical Systems, CRC Press, Boca Raton, 1995
S. Wiggins: Introduction to Applied Nonlinear Analysis and Chaos, Springer, Berlin, 1988

Fourier analízis és függvénysorok, BMETE92MM00, 3/1/0/v/5

A trigonometrikus rendszer teljessége. Fourier-sorok. A Parseval képlet és alkalmazásai. Ortogonális függvényrendszerek, Legendre polinomok, Haar- és Rademacher-féle rendszerek. Bevezetés a

waveletekbe, wavelet ortonormált rendszerek és alkalmazásai. Integrálható függvények Fourier-transzformációja.

Laplace-transzformáció és alkalmazásai. Fourier-sorok konvergenciája, Dirichlet-féle formula, Dini és Lipschitz konvergencia kritériumok. Fejér példája divergens Fourier sorra. Fourier-sorok összegezés, Fejér tétele, az Abel–Poisson-féle módszer.

Weierstrass approximációs tétele, Stone tétele és annak alkalmazásai. Legjobb megközelítés Hilbert-terekben, Müntz tétele a hézagos polinomok sűrűségéről.

Lineáris operátorokkal való közelítés, Lagrange interpoláció, Lozinski–Harshiladze-tétel. A legjobb polinomapproximáció hibabecslése, Jackson tételei. Pozitív lineáris operátorok approximációs tulajdonságai, Korovkin tétele, Bernstein polinomok, Hermite–Fejér operátor. Bevezetés a spline-approximációba, B-spline-ok, spline-ok konvergencia-tulajdonságai.

Irodalom:

N.I. Ahijezer: Előadások az approximáció elméletéről, Akadémiai Kiadó, Budapest, 1951

Szőkefalvi-Nagy Béla: Valós függvények és függvénysorok, Tankönyvkiadó, Budapest, 1975

G. Lorentz, M.V. Makovoz: Constructive Approximation, Springer, 1996

M.J.D. Powell: Approximation Theory and methods, Cambridge University Press, 1981

Parciális differenciálegyenletek 2, BMETE93MM03, 3/1/0/f/5

A Laplace-operator Szoboljev térben (ismétlés a BSc anyag alapján). Másodrendű lineáris parabolikus egyenletek gyenge és erős megoldásai. Ritz–Galerkin approximáció. Lineáris operátorfélcsoportok (Evans és Robinson szerint). Reakció-diffúzió (kvázilineáris parabolikus) egyenletek gyenge és erős megoldásai. Ritz–Galerkin approximáció. Nemlineáris operátorfélcsoportok (Evans és Robinson szerint). Csak példákban: monotonitás, maximum-elvek, invariáns tartományok, egyensúlyi helyzet stabilitásának vizsgálata linearizálással, utazó hullámok (Smoller szerint). Globális attraktor. Inerciális sokaság (Robinson szerint).

Irodalom:

L.C. Evans: Partial Differential Equations, American Mathematical Society, Providence, 2002

J. Smoller: Shock Waves and Reaction-Diffusion Equations, Springer, Berlin, 1983

J.C. Robinson: Infinite-dimensional Dynamical Systems, Cambridge University Press, 2001

Elméleti számítástudomány, BMETE91MM00, 3/1/0/f/5

A logikai programozás és gépi bizonyítás elméleti alapjai. Véges modellek és bonyolultság. Nemklasszikus logikák a számítástudományban: temporális, dinamikus, program logikák. Rekurzív függvények és a lambda-kalkulus kapcsolata. Boole-algebrák, reláció algebrák és alkalmazásai.

Fontosabb gépmodellek. Bonyolultságelméleti alapfogalmak, nevezetes idő és térosztályok. NP-teljesség. Randomizált számítások. Algoritmustervezési módszerek.

Fejlett adatszerkezetek, amortizációs elemzés. Mintaillesztés szövegben. Adattömörítés.

Irodalom:

Carmen, T.H., Leiserson, C.E., Rivest: Algoritmusok, Műszaki Kiadó, 1999

Rónyai L., Ivanyos G., Szabó R.: Algoritmusok, Typotex, 2001

Ferenczi M.: Matematikai Logika, Műszaki Kiadó, 2002

Galton, A.: Logic for Information Technology, Wiley, 1990

Algebrai és általános kombinatorika, BMEVISZM020, 3/1/0/f/5

A Young-tablók kombinatorikája, tablógyűrűk, Pieri-formulák, Schur-polinomok, Kostka-számok. Robinson–Schensted–Knuth megfeleltetés. Littlewood–Richardson-számok és -tétel. Nevezetes szimmetrikus polinomok és generátorfüggvényeik, Cauchy–Littlewood formulák. A szimmetrikus

polinomok alaptételének Garsia-féle általánosítása. Bázisok a szimmetrikus függvények gyűrűjében.

Fejezetek a kombinatorikus optimalizálás módszereiből: Mohó algoritmus, javító algoritmusok, matroid-elméleti alapfogalmak, matroid metszet algoritmus. Közelítő algoritmusok (pl. halmazfedés, Steiner-fák, utazó ügynök probléma). Ütemezési algoritmusok (egygépes ütemezés, ütemezés párhuzamos gépekre, ládapakolás).

Irodalom:

William Fulton, Young Tableaux: With Applications to Representation Theory and Geometry (London Mathematical Society Student Texts) (Paperback), Cambridge University Press, 1996
Richard P. Stanley: Enumerative Combinatorics I.- II., Cambridge University Press, 2001

Differenciálgeometria és topológia, BMETE94MM00, 3/1/0/v/5

Sima sokaságok, differenciál-formák, külső deriválás, Lie-deriválás. Stokes tétele, de Rham-kohomológia, Poincaré-lemma, Mayer–Vietoris egzakt sorozat, Poincaré-dualitás. Riemann-sokaságok, Levi–Civita konnexió, görbületi tenzor, állandó görbületű terek. Geodetikusok, exponenciális leképezés, geodetikus teljesség, a Hopf–Rinow tétel, Jacobi-mezők, a Cartan–Hadamard-tétel, Bonnet tétele.

Irodalom:

J. M. Lee: Riemannian Manifolds: an Introduction to Curvature, Graduate Texts in Mathematics 176, Springer Verlag
P. Petersen: Riemannian Geometry, Graduate Texts in Mathematics 171, Springer Verlag
J. Cheeger, D. Ebin: Comparison Theorems in Riemannian Geometry, North-Holland Publishing Company, Vol. 9, 1975
Szőkefalvi-Nagy Gy., Gehér L., Nagy P.: Differenciálgeometria, Műszaki Könyvkiadó, Budapest, 1979

Reprezentációelmélet, BMETE91MM02, 3/1/0/f/5

Differenciálható sokaságok, atlasz, sokaságok közti leképezések, immerzió, szubmerzió, részsokaság, érintő; tér, vektormező, Lie-derivált (szükség esetén topológiai hézagpótlás: kompaktság, összefüggőség, homotópia, fundamentális csoport). Vektornyalábok, alternáló formák vektortereken, differenciálformák és integrálásuk, Stokes-tétel (bizonyítás nélkül). Multilineáris algebrai konstrukciók (tenzorszorzat, szimmetrikus és alternáló szorzat, összehúzás) és alkalmazásuk vektornyalábokra. Lie-csoportok definíciója és alapvető tulajdonságaik, exponenciális leképezés, invariáns vektormezők, Lie-csoport Lie-algebrája. Mátrix Lie-csoportok és Lie-algebráik, fontos példák. Csoportok reprezentációelmélete általában, karakterek, lineáris algebrai konstrukciók, Lie-csoportok folytonos reprezentációi, összefüggés Lie-csoportok és a hozzájuk tartozó Lie-algebrák reprezentációi között. Lie-algebrák alapjai, derivációk, nilpotens és feloldható Lie-algebrák, Engel és Lie tételei, Jordan-Chevalley felbontás, Cartan-féle és maximális torális részalgebrák. Féligegyszerű Lie-algebrák, Killing-forma, reprezentációk teljes felbonthatósága. Az sl_2 Lie-algebra reprezentációelmélete, gyökrendszerek, Cartan-mátrix, Dynkin-diagram, gyökrendszerek osztályozása, féligegyszerű Lie-algebrák. Mátrix Lie-csoportok reprezentációi, Weyl-kamrák, Borel-részalgebra. Peter-Weyl tétel.

Irodalom:

Glen Bredon: Topology and Geometry, Springer Verlag (1997)
Jürgen Jost: Riemannian Geometry and Geometric Analysis, 4. kiadás, Springer Verlag (2005)
William Fulton, Joseph Harris: Representation Theory: a First Course, Springer Verlag (1999)
Daniel Bump: Lie Groups, Springer Verlag (2004)
James E. Humphreys: Introduction to Lie Algebras and Representation Theory, Springer Verlag (1997)

Globális optimalizálás, BMETE93MM00, 3/1/0/f/5

Globális optimalizálási feladatok különböző alakjai, ezek egymásba való átalakításai, redukálása egydimenziós feladatra. A globális optimalizálási feladat műveletigényének viszonya a lineáris programozáshoz. A globális optimalizálási módszerek osztályozásai. Lagrange-függvény, Kuhn–Tucker tétel, konvex-, DC programozás. Sztochasztikus programozás alapmodelljei, megoldó módszerek. Sztochasztikus és multi-start eljárások globális optimalizálásra, konvergenciájuk, megállási feltételeik. Lipschitz konstansra támaszkodó eljárások, konvergenciatételek. Korlátozás és szétválasztás módszere, intervallum aritmetikán alapuló eljárások, automatikus differenciálás. Több cél-függvényes optimalizálás.

Irodalom:

R. Horst and P. Pardalos: Handbook of Global Optimization, Kluwer, 1995

R. Horst, P.M. Pardalos, and N.V. Thoai: Introduction to Global Optimization, Kluwer, 1995

A. Törn and A. Zilinskas: Global Optimization, Springer, 1989

Lineáris programozás, BMETE93MM01, 3/1/0/v/5

Konvex poliéderek. Minkowski tétel, Farkas tétel, Weyl tétel, Motzkin felbontási tétele. A lineáris programozás feladata, példák lineáris programozási feladatra, grafikus szemléltetés. A lineáris programozási feladat megengedett megoldásának, bázismegoldásának fogalma, a szimplex módszer alap algoritmusa. A ciklizálás és annak kizárási lehetőségei: lexikografikus szimplex módszer, Bland szabály alkalmazása. Induló megengedett bázis keresése, a kétfázisú szimplex módszer. Az explicit bázis inverz és a módosított szimplex módszer. A lineáris programozás dualitás elmélete. Kiegészítő eltérések tételei. A játékelmélet. Kétszemélyes zérőösszegű játékok elmélete, Neumann János tétele. A duál szimplex módszer és a metszősík algoritmusok. A Gomory-féle metszősík algoritmus egészértékű programozási feladatok megoldására. Speciális lineáris programozási, illetve arra visszavezethető feladatok. Szállítási feladat, gráfelméleti alapfogalmak és azok alkalmazása a szállítási feladat szimplex módszerrel történő megoldására ('stepping stone' algoritmus). Duál változók módszere az optimalitás teszt gyors végrehajtására. Hozzárendelési feladat, König-Egerváry tétel és a magyar módszer. Hiperbolikus programozási feladat visszavezetése lineáris programozásra a Martos-féle módszerrel. Szeparábilis programozási feladat. Egyedi felső korlát technika. A Dantzig-Wolfe dekompozíciós eljárás, ellipszoid módszer és a belső pontos algoritmusok vázlata.

Irodalom:

Prékopa András: Lineáris programozás, I. Bolyai János Matematikai Társulat, 1968

A. Schrijver: Theory of Linear and Integer Programming, John Wiley, New York, 1986

R.J. Vanderbei: Linear Programming: Foundations and Extensions, Kluwer Academic Publishers, Dordrecht, 1997

Sztochasztikus analízis és alkalmazásai, BMETE95MM04, 3/1/0/v/5

Bevezetés, ismétlés: Markov-folyamat, sztochasztikus félcsoport, infinitezimális generátor, martingál, megállási idő.

Brown-mozgás: Brown-mozgás fenomenologikus leírása, véges dimenziós peremeloszlások, és folytonosság. Wiener-folyamat konstrukciója, erős Markov tulajdonság. Rekurrencia, skálázás, idő megfordítás. Tükrözési elv és alkalmazásai. Trajektóriák majdnem biztos analitikus tulajdonságai: folytonosság, Hölder-tulajdonság, nem differenciálhatóság, kvadratikusan variáció, szinthalmozok.

Folytonos martingálok: Definíció és jellemzés. Schwartz–Dubbins tétel. Exponenciális martingál.

Lévy-folyamatok: Független és stacionárius növekmények, Lévy–Hincsin formula és a folyamatok felbontása. Konstrukció Poisson pont folyamat segítségével. Szubordinátor folyamatok. Stabilis folyamatok. Példák és alkalmazások.

Sztocasztikus integrálás I.: Diszkrét sztocasztikus integrálás bolyongás szerint és diszkrét idejű martingál szerint. Alkalmazások, diszkrét Black–Scholes. Sztocasztikus integrálás Poisson-folyamat szerint. Diszkrét állapotterű Markov-folyamat martingáljai. Kvadratikus variáció, Doob–Meyer felbontás.

Sztocasztikus integrálás II.: Jóljelölt folyamatok és az Itô-integrál Wiener-folyamat szerint kvadratikus variáció folyamat. Doob–Meyer-felbontás. Itô-formula és alkalmazásai.

Irodalom:

K.L. Chung, R. Williams: Introduction to stochastic integration. Second edition. Birkhäuser, 1989

R. Durrett: Probability: theory and examples. Second edition. Duxbury, 1996

B. Oksendal: Stochastic Differential equations. Sixth edition. Springer, 2003

D. Revuz, M. Yor: Continuous martingales and Brownian motion. Third edition. Springer, 1999

G. Samorodnitsky & M. S. Taqqu: Stable Non-Gaussian Random Processes: Stochastic Models with Infinite Variance. Chapman and Hall, New York, 1994

válogatott cikkek, előadó jegyzetei

Statisztika és információelmélet, BMETE95MM05, 3/1/0/v/5

Becslések és hipotézisvizsgálat többdimenziós paraméterterben: Fisher-információs-mátrix, likelihood-hányados-próba. Hipotézisvizsgálat többdimenziós Gauss-modellben: Mahalanobis-távolság, Wishart-, Hotelling-, Wilks-eloszlások. Lineáris becslések, Gauss–Markov-tétel. Regresszióanalízis, egy- és többszemponos varianciaanalízis, mint lineáris modell. ANOVA-táblázatok, Fisher–Cochran-tétel. Főkomponens- és faktoranalízis. Faktorok becslése és forgatása, hipotézisvizsgálatok a faktorok számára.

Hipotézisvizsgálat és I-divergencia (diszkrét eset).

I-vetületek, exponenciális eloszláscsalád esetén a maximum likelihood becslés, mint I-vetület. A megfelelő I-divergencia-statisztika határeloszlása. Kontingenciatáblázatok analízise információelméleti módszerrel, loglineáris modellek. Információelméleti alapú statisztikai algoritmusok: iteratív arányos illesztés, EM-algoritmus. Maximális entrópia módszere.

Irodalom:

M. Bolla, A. Krámlí: Statisztikai következtetések elmélete, Typotex, Budapest, 2005

I. Csiszár, P. C. Shields: Információelmélet és statisztika. Oktatási segédanyag (angolul).

Alapok és trendek a kommunikáció- és információelméletben c. kiadványnak 420-525. oldala, Now Publ. Inc., Hollandia, 2004. (Szintén elérhető a Rényi Intézet www.renyi.hu honlapján, Csiszár Imre oktatási segédanyagainál.)

Alkalmazott analízis specializáció

Matematikai perkolációelmélet, BMETE95MM24, 2/0/0/f/3

A perkoláció jelensége, véletlen gráfok geometriája, fázisátmenet. Elemi eszközök: Harris egyenlőtlenség és p_c legegyszerűbb becslése. Végtelen klaszterek száma (unicitási tétel), a perkolációs valószínűség folytonossága p_c felett. Van den Berg–Kesten egyenlőtlenség, Russo formula. Fürteloszlás exponenciális lecsengése szubkritikus esetben (Aizenman–Barsky és Menshikov tételei). Kétdimenziós problémák: 1. Gráfok dualitása, Sykes–Essam sejtés, Russo–Seymour–Welsh tétel. 2. Kesten és Russo tételei: $p_c + p_c^* = 1$. 3. Kritikus perkoláció konform-invarianciája, Cardy formula, S. Smirnov tétele.

Irodalom:

H. Kesten: Percolation Theory for Mathematicians, Birkhäuser 1982

G. Grimmett: Percolation (2nd edition), Springer 1999

A klasszikus mechanika matematikai módszerei, BMETE93MM12, 2/0/0/f/2

A variációs számítás alapfeladata. Euler–Lagrange differenciálegyenletek. Geometriai módszerek a mechanikában. Lagrange- és Hamilton-rendszerek. Legendre transzformáció. Hamilton-egyenletek. Szimmetriák és megmaradási tételek.

Irodalom:

V.I. Arnold: A mechanika matematikai módszerei, Műszaki Könyvkiadó, Budapest, 1985

Numerikus módszerek 2 – Parciális differenciálegyenletek, BMETE92MM07, 2/0/2/v/5

Elliptikus parciális differenciálegyenletek numerikus megoldási módszerei: véges differencia módszer, multigríd módszer, végeelem módszer. Időfüggő parciális differenciálegyenletek numerikus megoldási módszerei: végeelem és véges differencia módszerek parabolikus és hiperbolikus feladatokra, Ritz- és Galjorkin-típusú módszerek. Stabilitás. CFL feltétel, von Neumann analízis. Lax ekvivalencia tétele. Operátorszeletelési eljárások és alkalmazásai. Parciális differenciálegyenletek és numerikus megoldási módszereinek alkalmazásai: Maxwell-egyenletek és numerikus módszerei, származtatott tözsdei termékek árazása, szilárdságtani feladatok, hővezetési egyenlet és numerikus megoldásainak kvalitatív vizsgálata, légszennyezés-terjedési modellek.

Irodalom:

Stoyan Gisbert, Takó Galina: Numerikus módszerek III, Typotex 1997

Alfio Quarteroni, Riccardo Sacco, Fausto Saleri: Numerical Analysis, Springer 2000

Stoyan Gisbert: Matlab, Typotex 2005

A. Quarteroni, A. Valli: Numerical Approximation of Partial Differential Equations, Springer-Verlag, Heidelberg, 1994, SCM Series n. 23.

Vektorterek a fizikában, BMETE92MM21, 2/0/0/f/2

A tenzorszorzat absztrakt definíciója és tulajdonságai. Lineáris leképezések tenzorszorzata és nyoma. A külső algebra alapvető tulajdonságai. Mátrixinvariánsok deficiója a tenzorszorzat segítségével, és kapcsolatuk a karakterisztikus egyenlettel. Hodge-operátor a külső algebrán. Differenciálható sokaságok alapjai. Divergencia, gradiens és Laplace-operátor sokaságokon. Külső deriválás. A téridőn értelmezett Maxwell-egyenletek koordinátamentes alakja. Maxwell-egyenletek felírása görbült téridőn. Gauss-Osztrogradszkij-Stokes féle integráltétel tetszőleges dimenziójú részsokaságra, számolási példákkal.

Irodalom:

Y. Choquet Bruhat, Analysis, Manifolds and Physics I. II. (Elsevier Sci. B. V., Amsterdam 1996).

Szente J. Bevezetés a sima sokaságok elméletébe (ELTE Eötvös kiadó, Budapest 2002).

Mátrixanalízis, BMETE92MM03, 2/0/0/v/3

Lineáris terek, lineárisan független vektorok, bázis, lineáris leképezések és mátrixuk. Belső szorzat, Hilbert-tér, ortonormált bázis. Normák a mátrixtereken. Önadjungált és unitér mátrixok. Mátrixok sajátvektorai, sajátértékek és szinguláris értékek, valamint a lokalizációjuk. Pozitív definit mátrixok és tulajdonságaik. Mátrixok tenzorszorzata és Hadamard-szorzata, Schur-lemma, ezeknek a szorzatoknak az alkalmazásai. Mátrixok függvényei, a rezolvens és az exponenciális függvény tulajdonságai, Lie-Trotter formula. Mátrixfüggvények differenciálása. Egyenlőtlenségek: Mátrixmonoton és

mátrixkonvex függvények, exponenciális, logaritmus- és hatványfüggvények. Blokkmátrixok tulajdonságai és használata. Mátrixok számtani és mértani közepe. Mátrixok alkalmazása lineáris differenciálegyenletek megoldására. Pozitív elemű mátrixok.

Irodalom:

Rajendra Bhatia: Matrix Analysis, Springer, 1997

Kérchy László: Bevezetés a véges dimenziós vektorterek elméletébe, Polygon, 1997

Petz Dénes: Lineáris analízis, Akadémiai Kiadó, 2002

Rózsa Pál: Lineáris algebra és alkalmazásai, Műszaki Könyvkiadó, 1976

Matematikai kémia, BMETE92MM09, 2/0/2/v/5

Az alkalmazott matematikus néhány fontos eszköze: Speciális függvények, Laplace-transzformáció, kvalitatív vizsgálatok, nemlineáris rendszerek, túl az elemi statisztikán, matematikai programcsomagok. Optimumszámítási modellek, differenciálegyenletek paramétereinek becslése.

Modellekről: statikus és dinamikus, diszkrét és folytonos, sztochasztikus és determinisztikus, lineáris és nemlineáris modellek.

A fizikai kémia problémái. A homogén reakciókinetika modelljei és problémái. Sztöchiometria: lineáris algebrai és számelméleti módszerek. Tömeghatás típusú kinetika: gráfokon értelmezett differenciálegyenletek. Egyensúly, oszcilláció, káosz. Érzékenységvizsgálat. Modellredukció. Sztochasztikus reakciókinetika: ugró Markov-folyamatok. Biokémiai alkalmazások, enzimkinetika, farmakokinetika, gyógyszeradagolás, gyógyszertervezés. Kvantitatív összefüggések molekulák szerkezete és hatása között. Kvantumkémiail alkalmazásokról. Neurobiológia. Reakció-diffúziómodellek. Mintázatképződés kémiai, biológiai és közgazdasági modellekben.

Irodalom:

Bazsa Gy. (szerk.): Nemlineáris dinamika és egzotikus kinetikai jelenségek kémiai rendszerekben, Egyetemi jegyzet (Kézirat), Debrecen, Budapest, Gödöllő, 1992

Érdi, P., Tóth, J.: Mathematical Models of Chemical Reactions. Theory and Applications of Deterministic and Stochastic Models, Princeton University Press, Princeton, 1989

Feinberg, M.: Lectures On Chemical Reaction Networks (Lecture notes)

www.che.eng.ohio-state.edu/~FEINBERG/LecturesOnReactionNetworks/

Farkas Miklós: Dynamical Models in Biology, Academic Press, New York, 2001

Murray, J. D.: Mathematical biology, Springer, 2004

Operátorelmélet, BMETE92MM05, 3/1/0/v/5

Hilbert terek alapfogalmait ismertnek feltételezzük. Zárt és lezárható operátorok, a zárt gráf tétel. A spektrálmélet alapjai zárt operátorokra. Zárt szimmetrikus és önadjungált operátorok. Szimmetrikus operátor és önadjungált kiterjesztése. Hermitikus forma által definiált operátorok. Zárt normális operátorok.

Véges rangú és kompakt operátorok. Hilbert–Schmidt operátorok. Mátrix operátorok.

Integrálás spektrál mértékre vonatkozóan. Zárt önadjungált operátorok spektrálfelbontása és spektrumának tulajdonságai. Normális operátorok spektrálfelbontása.

Szimmetrikus operátorok kiterjesztései: defekt indexek és Cayley transzformáltak. Kiterjesztés a Hilbert tér bővítésével: Najmark tétele. Önadjungált kiterjesztések és spektrumaik. Analitikus vektorok. Önadjungált operátorok perturbációja. Scattering. Egyoldali eltolás operátora, Wold–Neumann felbontás. Kétoldali eltolás. Kontrakciók. Invariáns vektorok, kanonikus felbontás. Kontrakció izometrikus és unitér dilatációja.

Operátorok Banach terekben. Holomorf függvények és kontúrintegrálok. Holomorf függvénykalkulus korlátos, ill. zárt operátorokra. Kompakt operátorok. A Riesz–Schauder elmélet. Nöther és Fredholm operátorok. Operátor félcsoportok Banach terekben. Lineáris rendszerek operátorelméleti alapjai.

Banach algebrák. Spektrum. Holomorf függvénykalkulus. Ideálok. A Gelfand transzformáció. C^* -algebra elemének spektruma. A Gelfand–Najmark kommutatív tétel. C^* -algebrák reprezentációja.

Irodalom:

I. Gohberg, S. Goldberg and M.A. Kaashoek: Basic classes of linear operators. Birkhauser, Basel, 2003

J. Weidmann: Linear operators in Hilbert space. Springer, Berlin, 1980

M. Birman and M. Solomyak: Spectral theory of self-adjoint operators in Hilbert space. Leningrad, 1980 (in Russian. There is also an English translation of the book).

Potenciálelmélet, BMETE92MM04, 2/0/0/f/3

Motiváció: elektrosztatika. Dirichlet probléma, Brown mozgás. Logaritmikus potenciál: minimum-elv, extrémális mérték, egyensúlyi potenciál, mérték és potenciál kapcsolata. Súlyozott polinomok: súlyozott Fekete-pontok, transzfinit átmérő, Csebisev-polinom. Dirichlet probléma nem folytonos ill. nem korlátos peremfeltétellel. (Perron-Wiener-Brelot megoldás, súlyozott terek, harmonikus mérték.) Regularitási problémák, kisöprési mérték, Brown-mozgás és harmonikus mérték kapcsolata.

Irodalom:

D. R. Adams and L. I. Hedberg, Function Spaces and Potential Theory, Springer, 1996

V. I. Fabrikant, Mixed Boundary Value Problems of Potential Theory and their Applications in Engineering, Kluwer Acad. Publ. Group, Netherlands, 1991

J. L. Dob, Classical Potential Theory and Its Probabilistic Counterpart, Springer, 1984

O. D. Kellogg, Foundations of Potential Theory, Springer, 1929

H. N. Mhaskar, Introduction to the Theory of Weighted Polynomial Approximation, World Scientific, 1996

(Szerk.) K. Nagy, Elméleti fizikai példatár, Tankönyvkiadó, 1981

T. Ransford, Potential Theory in the Complex Plane, Cambridge Univ. Press, 1994

E. B. Saff and V. Totik, Logarithmic Potentials with External Fields, Springer, 1997

Inverz szórási feladatok, BMETE92MM08, 2/0/0/v/3

A látás, a radar, az ultrahangos orvosi vizsgálat, a földkéreg szerkezetének kutatása, az elemi részecskék közti kölcsönhatások vizsgálata csak néhány példa inverz szórási feladatokra. A kurzus célja ezen problémák matematikai apparátusának bemutatása, bevezető jelleggel. A főbb témakörök: Időfüggő felépítés: hullámoperátor, szórási operátor, szórásmatrix. Időfüggetlen felépítés: szórásamplitúdó, Lippmann–Schwinger egyenlet. Dirichlet-to-Neumann operátor, Sylvester–Uhlmann alaptétel. Akusztikus szórás, elektromágneses szórás. Egy- és háromdimenziós kvantum-szórási feladatok. A kvantummechanikai soktest-probléma.

Irodalom:

V. Isakov, Inverse Problems for Partial Differential Equations, Springer, New York 1998

D. Yafaev, Scattering Theory: Some Old and New Problems, Springer, Berlin, 2000

D. Colton and R. Kress, Inverse Acoustic and Electromagnetic Scattering Theory, Springer, Berlin 1998

M. Reed and B. Simon, Methods of Modern Mathematical Physics III: Scattering Theory, Academic Press 1979

K. Chadan and P. Sabatier, Inverse Problems in Quantum Scattering Theory, Springer 1989

Disztribúcióelmélet és Green-függvények, BMETE92MM22, 2/0/0/v/2

Általánosított függvény (disztribúció), reguláris disztribúció, disztribúció tartója, szorzása függvénynel. Disztribúciók konvergenciája, simítás konvolúcióval. Temperált disztribúció. Függvény nyoma egy tartomány határán. Függvényterek, beágyazási tételek. Fourier transzformáció: azonos-

ságok, hatása L^2 -n, az alapfüggvények terén, disztribúciókon és temperált disztribúciókon. Alapmegoldás másodrendű elliptikus egyenletre. Green operátor (rezolvens operátor) tulajdonságai Dirichlet, Neumann és Robin peremfeltételek esetén. Önadjungáltság, kompaktság. Kato-Rellich tétel önadjungált operátor perturbációjáról. Lényegében önadjungált operátorok. Alkalmazás Schrödinger operátorokra. Green-függvény: a rezolvens operátor magfüggvénye. Példák: egyváltozós Schrödinger operátor, többváltozós Laplace operátor. Kapcsolata az alapmegoldással. Szingularitás a főátló közelében. A spektrum részei. Spektrálsorfejtés sajátfüggvényekkel és általánosított sajátfüggvényekkel. Általánosított Fourier transzformált. A Schrödinger operátor diagonalizálása. Green-függvény felírása általánosított sajátfüggvényekkel.

Irodalom:

Gnädig Péter: Bevezetés a disztribúcióelméletbe és fizikai alkalmazásaiba, Tankönyvkiadó, 1981.

S. Mizohata: The Theory of Partial Differential Equations, Cambridge Univ. Press 1973.

V. Sz. Vlagyimirov: Bevezetés a parciális differenciálegyenletek elméletébe, Műszaki Könyvkiadó 1979.

A klasszikus mezőelméletek geometriája, BMETE94MM11, 2/0/0/f/2

Klasszikus elektrodinamika: a Maxwell-egyenletek formás alakja; a vektorpotenciál bevezethetősége kohomologikus szempontból; mérce-transzformáció; az elektrodinamika reprezentációja spinormezőkön; a Diracegyenlet; mágneses monopólusok az elektrodinamikában: a Dirac-féle töltéskvantálás. A Riemann-geometria elemei: differenciálható sokaságok feletti vektornyalábok definíciója, példák; kovariáns deriválás (konnexió, párhuzamos eltolás) vektornyalábokon; a görbületi tenzor előállítása a párhuzamos eltolás sorfejtése segítségével; a Riemann görbületi tenzor és annak szimmetriái. Az általános relativitás-elmélet elemei: az $SO(4)$ csoport véges dimenziós komplex reprezentációinak osztályozása; a Riemann görbületi tenzor invariáns dekompozíciója: a skalárgörbület, a nyomtalan Ricci-tenzor és a Weyl-tenzorok bevezetése; a vákuum Einstein-egyenlet (e fogalmak áttekintése Lorentz-esetben is). A Yang–Mills-elmélet elemei: A Yang–Mills-egyenletek; (anti)önduális konnexiók (insztantonok) fogalma, Atiyah, Hitchin, Singer tételei. Komplex- és majdnem komplex sokaságok: definíciója, holomorf vektornyalábok; tenzorok felbontása majdnem komplex sokaságok felett; a majdnem komplex-sokaságok integrálhatóságára vonatkozó Newlander–Nirenberg-tétel kimondása. A tvisztor-tér fogalma: egy négydimenziós irányított Riemann-sokaság tvisztor-tere; ezen kanonikus majdnem komplex struktúra előállítása; a majdnem komplex struktúra integrálható, ha a Riemann-sokaság félig konformálisan lapos (Penrose, Atiyah–Hitchin–Singer); példák tviszorterekre: a kerek S^4 tvisztor-tere CP^3 és ennek csodálatos geometriája. Az ADHM-konstrukció: az (anti)öndualitási-egyenletek megoldása tvisztor-terekkel.

Irodalom:

Fizika és geometria (Fizikus-matematikai nyári iskola, Óbánya, 1997) Szerk.: Barnaföldi G., Rimányi R., Matolcsi, T., MAFIHE, Budapest (1999)

R.S. Ward, R.O. Wells: Twistor geometry and field theory, Cambridge Univ. Press, Cambridge (1991)

R.M. Wald: General relativity, University of Chicago press, Chicago (1984)

A statisztikus fizika matematikai módszerei, BMETE95MM27, 2/0/0/v/3

Valószínűségszámítási bemelegítés: határeloszlástételek, nagy eltérés tétel. A statisztikus fizika matematikai megfogalmazása: Gibbs mértékek, kapcsolat nagyeltérés elmélettel; A fázisátmenetek problémája. Mean-field (átlag mező) elméletek: a kritikus fluktuációk leírása – Ellis-Newman tétel. Ising- és rácsgáz modellek. Magas hőmérséklet: sorfejtések, analitikusság, Kirkwood-Salsburg egyenletek. Fázisátmenetek matematikája: Lee-Yang tétel; Peierls féle kontúr módszer. Korrelációs egyenlőtlenségek (Griffeaths, Fortuin-Kasteleyn-Ginibre). Folytonos szimmetriájú modellek: klaszszikus Heisenberg modell. 2-dimenzióban nincs fázisátmenet: Mermin-Wagner tétel. $d = 3$ -ban van fázisátmenet: Fröhlich-Simon-Spencer tétel.

Operációkutatás specializáció

Nemlineáris programozás, BMETE93MM04, 3/1/0/v/5

Előkövetelmény: **Lineáris programozás**

1. Optimalitás feltételei: Elsőrendű szükséges feltételek (feltétel nélküli optimalizálás). Másodrendű szükséges + elégséges feltételek (feltétel nélküli optimalizálás). Konvex (és konkáv) függvények tulajdonságai, minimalizálás és maximalizálás. Ponthalmaz leképezések, zártság, összetett leképezések, globális konvergencia-tétel.

2. Vonal menti optimalizálás: Konvergencia-sebesség, Armijo szabály. Fibonacci, aranymetszés, Newton módszer vonal menti optimalizálásra. Görbe illesztéses algoritmusok, pontatlan vonal menti optimalizálás zártsága.

3. Feltétel nélküli optimalizálás: Legmélyebb leszállás algoritmus, Kantorovich egyenlőtlenség, konvergenciasebesség. Newton módszer. Koordinátánkénti minimalizálás, konvergencia és zártság, távolságtartó lépések. Konjugált irányok, kiterjeszkedő alterek. Konjugált gradiens módszer, optimalitása. A részleges konjugált gradiens módszer, konvergenciasebesség. Nem-kvadratikus problémák, Fletcher–Reeves, PARTAN Kvázi-Newton módszerek, legmélyebb leszállás és Newton módszer kombinációja.

Legkisebb négyzetek módszere, Gauss–Newton és Levenberg–Marquardt algoritmus

4. Feltételek melletti optimalizálás: Tangens sík, regularitás – feltételek karakterizálása. Elsőrendű szükséges feltételek. Másodrendű szükséges és elégséges feltételek. Primál módszerek, megengedett irányok (Zoutendijk).

Aktív halmaz stratégia, munkahalmaz, Langrange szorzók szerepe, érzékenység. Kuhn–Tucker tétel.

Gradiensvetítés, lineáris feltételek esetén, nemlineáris feltételek esetén. A redukált gradiens módszer. Büntető és korlát függvények módszerei. Lokális dualitás tétel. Duál és metszősík módszerek. Lineáris komplementaritási feladat. A kvadratikus programozási feladat és a komplementaritási feladat kapcsolata. Belsőpontos algoritmusok.

Irodalom:

D.G. Luenberger: Linear and Nonlinear Programming, second edition, Addison Wesley, 1984.

M.S Bazaraa, H.D.Sherali, C.M.Shetty: Nonlinear Programming: Theory and Algorithms, John Wiley and Sons, New York, 1993.

E.deKlerk, C.Roos, T.Terlaky: Nemlineáris optimalizálás, Operációkutatás sorozat, No. 5., Aula kiadó.

Kombinatorikus optimalizálás, BMEVISZM029, 3/1/0/v/5

Gráfelméleti algoritmuscsaládok (legrövidebb út, párosítás, hálózati folyamok, a PERT-módszer) átvizsgálása, nevezetes NP-teljes feladatok a gráfelméletben (pontszínezés, független pontok maximális száma, maximális klikk-méret, Hamilton-kör és -út létezése, az utazó ügynök problémája, irányított köröket lefogó maximális halmazok) és rokon területeken (az egészértékű programozás alapfeladata, a többtermékes folyamprobléma). A lineáris programozás dualitás tételének alkalmazásai, egészértékű programozás, kombinatorikus optimalizálási feladatok, totális unimodularitás: maximális összsúlyú teljes párosítás (optimal assignment), minimálköltségű folyamprobléma egytermékes hálózatban. Matroidok definíciója, bázis, kör, rang, dualitás, minorok. Grafikus és koordinátázható matroidok, Tutte és Seymour tételei. Orákulumok, mohó algoritmus, k-partíció és 2-metszet algoritmus, a 3-metszet probléma, polimatroidok. Polinomrendű algoritmusokkal megold-

ható nevezetes műszaki problémák: a) a villamos hálózatok klasszikus elméletében (ellenálláshálózatok egyértelmű megoldhatósága, gráfok kör- és vágásmátrixainak tulajdonságai, általánosítás passzív és/vagy nonreciprok hálózatokra), b) a nagybonyolultságú áramkörök tervezésében (egyetlen pontsor huzalozása a Manhattan-modellben, csatornahuzalozás a különféle modellekben, az éldiszjunkt modell alkalmazása) és c) a rúdszerkezetek merevségével kapcsolatos kérdésekben (merevség, infinitezimális merevség, genetikus merevség, Laman tétele, Lovász és Yemini algoritmus, a síkbeli rúdszerkezetek minimális számú csuklóval való lefogásának problémája, négyzetrácsok merevítésének kombinatorikus kérdései).

Irodalom:

Jordán Tibor, Recski András és Szeszlér Dávid: Kombinatorikus optimalizálás, Typotex Kiadó, Budapest, 2004

Sztochasztikus programozás, BMETE93MM05, 3/1/0/v/5

Statisztikai döntési elvek. Pétervári probléma, Bernoulli-elv és az újságáros probléma, holland gátmagasítási probléma, 'safety first' elv, Marschak döntési elv, a Bayes-i döntési elv, Markowitz elv, játékelmélet, Neumann János tétele.

Konvexitási tételek. A logkonkáv mértékek elmélete. Általános konvexitási tételek. Valószínűségi eloszlásfüggvények konkávitási és kvázi-konkávitási tételei.

Statikus sztochasztikus programozási modellek. Valószínűség maximalizálás. Egyedi, illetve együttes valószínűségi korlátokat tartalmazó sztochasztikus programozási feladatok elmélete és megoldási módszerei. Feltételes várható értéket tartalmazó modellek. Véletlen célfüggvényes modellek. Büntetéses sztochasztikus programozás elmélete és speciális esetekre vonatkozó megoldási módszerei: diszkrét eloszlás, egyenletes eloszlás esete.

Dinamikus sztochasztikus programozási modellek. Kétlépcsős sztochasztikus programozási feladat és matematikai tulajdonságai. Diszkrét valószínűségi vektorváltozóra vonatkozó kétlépcsős sztochasztikus programozási feladat megoldása bázis dekompozíciós módszerrel. A Wets-féle , 'L-shaped' megoldási módszer. A sztochasztikus dekompozíció és a feltételes sztochasztikus dekompozíció módszere. Sztochasztikus kvázi-gradiens módszerek. Többlépcsős sztochasztikus programozási feladatok. Bázis dekompozíció és 'L-shaped' megoldó módszer a többlépcsős sztochasztikus programozási feladatok esetében.

A sztochasztikus programozás néhány alkalmazása. Elektromos energia véletlen hatások melletti termelése és kapacitás bővítése. Erőművi megbízhatósági elemzések. Tó vízkészlet szabályozása. Tározók optimális irányítása. A PERT probléma. Pénzügyi modellek.

Irodalom:

A. Prékopa: Stochastic Programming, Kluwer Academic Publishers, Budapest, 1995

Operációkutatási programrendszerek, BMETE93MM06, 0/0/2/f/2

A tantárgy célja kettős, egyrészt hogy az operációkutatás egyszerűbb algoritmusai számítógépes kódjának az elkészítésével a hallgatók számítógépes programozói gyakorlatra tegyenek szert, másrészt hogy jártasságot szerezzenek a kész operációkutatási szoftverek használatában. A lineáris programozási feladatok standard leírási módja, az MPS adatformátum, illetve a legfontosabb algebrai modellezési nyelvek (GAMS, AMPL, AIMMS) és az azokhoz kapcsolt lineáris, egészértékű, nemlineáris és sztochasztikus programozási szoftverek (CPLEX, MINOS, SNOPT, LOQO, LGO) ismertetése.

Irodalom:

I. Maros: Computational Techniques of the Simplex Method, Kluwer Academic Publishers, 2003

J. D. Pintér: Global Optimization in Action, Continuous and Lipschitz Optimization: Algorithms, Implementations and Applications, Kluwer Academic Publishers, 1996

Irányítási rendszerek, BMETE93MM07, 2/0/0/v/3

Irányítási rendszerek fogalma, példák irányítási rendszerekre. Lineáris rendszerek tulajdonságai: irányíthatóság, megfigyelhetőség, stabilizálhatóság. Kanonikus alakok, lineáris rendszerek struktúrája. Állapotmegfigyelők. Realizáció. Optimális irányítási feladat. Dinamikus programozás véges feladatra. Dinamikus programozás általános rendszerre. A Hamilton–Jacobi–Bellman egyenlet. Lineáris-kvadratikus feladat. A pályakövetés feladata. Végtelen időintervallumon tekintett feladat.

Irodalom:

E. D. Sontag: *Mathematical Control Theory*, 2nd ed. (1998)

Gyurkovics Éva: *Irányítási rendszerek*, www.math.bme.hu/~gye/OktAny.htm

Bevezetés a közgazdasági dinamikába, BMETE93MM08, 3/1/0/v/5

A hagyományosan statikus közgazdaságtan az utóbbi évtizedekben egyre nagyobb figyelmet fordít a dinamikus közgazdaságtani modellezésre. A fizikához és a biológiához képest itt sokkal fontosabb a diszkrét idejű rendszerek elemzése. A dinamikus optimalizálás nemcsak technika, hanem sokak számára az egyedül lehetséges közgazdasági megközelítés. A téma további megkülönböztető sajátossága, hogy a várakozásokon keresztül nemcsak a múlt, de a jövő(kép) is befolyásolja a jelent. A tantárgy a szükséges matematikai eszközök mellett nagy súlyt helyez a legfontosabb közgazdasági modellek ismertetésére: optimális növekedés, együttélő korosztályok.

A tárgy felépítése: Lineáris differenciaegyenletek: készletjelzéses szabályozás. Nemlineáris differenciaegyenletek: stabilitás, ciklus és káosz. Differenciálegyenletek: növekedési modell, árigazodási modell. Dinamikus programozás: optimális halászat. Optimális folyamatok: optimális növekedés és felhalmozás. Együttélő nemzedékek modelljei. Együttélő korosztályok modelljei

Irodalom:

Simonovits, A.: *Matematikai módszerek a dinamikus közgazdaságtanban*, Közgazdasági és Jogi Könyvkiadó, Budapest, 1998

Játékelmélet, BMETE93MM09, 2/0/0/f/3

A tárgy bevezetést nyújt a játékelméletbe, különösen annak nem-kooperatív változatába.

A játékelmélet olyan gazdasági, politikai, katonai stb. helyzeteket modellez, ahol több szereplő optimalizálja a célfüggvényét, amely értéke a többi szereplő döntésétől is függ. A játékelmélet napjainkban a közgazdaságtan alaptudományává válik, amely segítséget nyújt a monopolhelyzetek modellezéséhez, az optimális árverés rendszerének kidolgozásához és még sok más kérdés megválaszolásához.

Az előadások szerkezete a következő: Nem kooperatív játékelmélet. Nash egyensúly. Tökéletes egyensúly. Bayes-i egyensúly.

Irodalom:

Tirole, J. (1988): *The Theory of Industrial Organization*, Chapter 11, MIT Press, Cambridge, MA.

Ökonometria, BMETE93MM10, 0/0/2/f/2

Kétváltozós kapcsolatok: lineáris regresszió, legkisebb négyzetes (LS) becslés és statisztikai tulajdonságai, Gauss-Markov tétel, predikció. Többváltozós lineáris regresszió korrelálatlan, azonos szórású hiba, illetve általános hibafolyamat esetén, általános Gauss-Markov tétel, előrejelzés, multi-kollinearitás.

Általánosított LS módszer, speciális esetek (autokorrelált zaj, nem azonos szórású korrelálatlan zaj), segédváltozók (IV) módszere.

Idősorok elemzése: stacionaritás, autokorreláció, fehérzaj folyamat, speciális modellek (lineáris szűrők, autoregresszív (AR) folyamat, mozgóátlag (MA) folyamat, ARMA folyamatok). Paramé-

terbecslés (ML-becslés), előrejelzés. Integrált és kointegrált folyamatok (ARIMA modellek), trend, szezonális.

Spektrálreprezentáció, periodogram és becslése, spektrum becslése.

Többváltozós modellek: VAR(1) folyamatok, n-dimenziós ARMA folyamatok, stacionaritás, stabilitás, Lyapunov egyenlet.

Frakcionálisan integrált folyamatok, ARFIMA modellek, hosszú emlékezetű folyamatok és becslésük.

Sztochasztikus volatilitás modellek: ARCH és GARCH folyamatok, bilineáris folyamatok és jellemzőik, stacionaritás, paraméterbecslés, állapotér reprezentáció.

Alkalmazások: pénzpiaci hozamok idősorának vizsgálata, biológiai adatok elemzése.

Irodalom:

Tusnády G. - Ziermann M.: Idősorok analízise, Műszaki, 1986

Ramu Ramanathan: Bevezetés az ökonometriába, PANEM, Budapest, 2003

G.E.P Box and G.M. Jenkins: Time Series Analysis, Forecasting and Control, Holden Day, 1970

Pénzügy-matematika specializáció

Nemparaméteres statisztika, BMETE95MM20, 2/0/0/v/3

Sűrűségfüggvény-becslés: Eloszlásbecslés, L1 hiba. Hisztogram. Magfüggvényes becslés.

Regressziófüggvény-becslés.: Négyzetes hiba. Regressziófüggvény. Partíciós, magfüggvényes, legközelebbi szomszéd becslés. Empirikus hibaminimalizálás.

Alakfelismerés: Hibaválósínúség. Bayes döntés. Partíciós, magfüggvényes, legközelebbi szomszéd módszer. Empirikus hibaminimalizálás.

Portfólió-stratégiák: Log-optimalitás, empirikus portfólió-stratégiák. Tranzakciós költség.

Irodalom:

L. Devroye, L. Györfi: (1985) Nonparametric Density Estimation: the, Wiley. Russian translation: Mir, 1988

L. Devroye, L. Györfi, G. Lugosi: (1996) Probabilistic Theory of Pattern Recognition, Springer, New York

L. Györfi, M. Kohler, A. Krzyzak, H. Walk: (2002) A Distribution-Free Theory of Nonparametric Regression, Springer, New York

Statisztikai programcsomagok 2, BMETE95MM09, 0/0/2/f/2

A kurzus célja a statisztika modern számítógépes eszközeinek áttekintése a szükséges elméleti háttér ismertetésével.

1. SPSS használata program módban. Felhasználói programrészletek írása. A programok outputjainak értelmezése (az ott fellépő statisztikák jelentése és angol elnevezése) és ennek megfelelően a paraméterek beállítása.

2. S+ és R programcsomag használata és az SPSS-ben nem található új algoritmikus modellek áttekintése (bootstrap, jackknife, ACE).

3. Konkrét alkalmazás: Egy konkrét adatrendszer részletes elemzése S+-ban.

Irodalom:

K. V. Mardia, J. T. Kent, M. Bibby: Többváltozós analízis, angolul, Academic Press, New York, 1979

Ketskemény, L., Izsó, L., Bevezetés az SPSS programrendszerbe, ELTE Kiadó, Budapest, 2005
S+ vagy R Felhasználói útmutató (a programcsomaggal együtt letölthető)

Biostatisztika, BMETE95MM25, 0/2/0/f/3

Bevezetés az epidemiológiába. Klasszikus epidemiológiai esettanulmányok. Előrejelzések, modellek. Többváltozós logisztikus regresszió. Túlélés analízise. Torzítások az epidemiológiai esetekben. Példák, esettanulmányok, a SAS szoftver használata.

Irodalom:

Kenneth J. Rothman: Epidemiology – an Introduction,

David W. Hosmer, Stanley Lemeshow, Rodney X. Sturdivant: Applied Logistic Regression,

David W. Hosmer, Jr. and Stanley Lemeshow: Applied Survival Analysis: Regression Modeling of Time to Event Data

Markov-folyamatok és martingálok, BMETE95MM07, 3/1/0/v/5

1. Martingálok: Ismétlés (Feltételes várható érték és toronyszabály, valószínűségi konvergenciatípusok és kapcsolataik, martingálok, megállított martingálok, Doob dekompozíció, kvadratikus variáció, maximál-egyenlőtlenségek, martingál konvergencia tételek, opcionális megállítási tétel, lokális martingálok). Martingálok konvergenciahalmazai, a négyzetesen integrálható eset. Alkalmazások (pl. Gambler's ruin, urnamodellek, szerencsejáték, Wald-azonosságok, exponenciális martingál). Martingál CHT, alkalmazások. Höffding–Azuma egyenlőtlenség és alkalmazásai (pl. utazó ügynök probléma)

2. Markov láncok: Ismétlés (definíciók, állapotok osztályozása, stacionárius eloszlás, reverzibilitás, tranziencia-(null-)rekurrencia). Elnyelési valószínűségek. Martingálok alkalmazásai, Markov-lánc CHT. Markov-láncok és dinamikai rendszerek; ergodtételek Markov-láncokra. Bolyongások és elektromos áramkörök.

3. Felújítási folyamatok: Laplace transzformált, konvolúció. Felújítási folyamat, felújítási egyenlet. Felújítási tételek, regeneratív folyamatok. Stacionárius felújítás, felújítási paradoxon. Sorbanállási alkalmazások

4. Pontfolyamatok: Pontfolyamatok definíciója. Poisson pontfolyamat egy és több dimenzióban. Poisson folyamat transzformációi (jelölés és ritkítás, transzformálás függvényrel, alkalmazások). Poisson pontfolyamatból származtatott pontfolyamatok

5. Diszkrét állapotterű Markov-folyamatok: Ismétlés (generátor, kapcsolat Markov-láncokkal, Kolmogorov előre és hátra egyenlet, állapotok osztályozása, tranziencia-(null-)rekurrencia, stacionárius eloszlás). Reverzibilitás, MCMC. Abszorpciós valószínűségek és elérési idők. Martingálok alkalmazásai (pl. ugró folyamatok kompenzátora). Markov-folyamatok és dinamikai rendszerek; ergodtételek Markov-folyamatokra. Lokálisan diszkrét állapotterű Markov-folyamatok: generátor tesztfüggvényeken

Irodalom:

Karlin, S.; Taylor, H. M.: Sztochasztikus folyamatok. Gondolat Kiadó, 1985 Budapest

Lindvall, T.: Lectures on the Coupling Method. Dover Publications, Inc., Mineola, NY, 2002.

Norris, J. R.: Markov chains. Cambridge University Press, Cambridge, 1998.

Resnick, S.: Adventures in Stochastic Processes. Birkhäuser Boston, 1992.

Rosenblatt, M.: Markov processes. Structure and Asymptotic Behavior. Springer-Verlag, New York-Heidelberg, 1971.

Williams, D.: Probability with Martingales. Cambridge University Press, 1991.

Sztochasztikus differenciálegyenletek BMETE95MM08 3/1/0/v/5

Előkövetelmény:

Sztochasztikus analízis és alkalmazásai ÉS Markov-folyamatok és martingálok

Bevezetés, ismétlés: Ito-integrál Wiener-folyamat szerint, integrálás folytonos martingál szerint, többdimenziós sztochasztikus integrál.

Lokális idő: Egydimenziós bolyongás lokális ideje, inverz lokális idő, diszkrét Ray–Knight-tétel. Egydimenziós Brown-mozgás lokális ideje és a folytonos Ray–Knight-tétel. Tanaka-formula és alkalmazásai. Szkorohod-tükrözés, tükrözött Brown-mozgás, P. Lévy egy tétele.

Sztochasztikus differenciálegyenletek: A diffúziós alappéldák (Ornstein–Uhlenbeck, Bessel, Bessel-squared, exponenciális Brown) SDE-i. Transzformált diffúzió SDE-je. Gyenge és erős megoldások, létezés, egyértelműség, nem-egyértelműség. Peremfeltételek és az infinitezimális generátor pontos értelmezése. Sztochasztikus differenciálegyenletek alkalmazásai fizikában, populáció dinamikában, gazdaságtudományban.

Diffúziók: Alappéldák: Ornstein–Uhlenbeck-, Bessel-, Bessel-squared-folyamatok, geometriai Brown-mozgás. Diffúziók, mint sztochasztikus integrálok és mint Markov-folyamatok. Infinitezimális generátor, sztochasztikus félcsoport. A martingál-probléma. Kapcsolat parabolikus és elliptikus parciális differenciálegyenletekkel. Feynman–Kac-formula. Idő-csere és Cameron–Martin–Girszanov-formula.

Egydimenziós diffúziók sajátosságai: Skála-függvény és sebesség-mérték. Peremfeltételek egy pontban. Idő-megfordítás. Alkalmazások konkrét folyamatokra.

Speciális kiegészítő fejezetek: Brownian excursion, kétdimenziós Brown-mozgás, SLE, Markov-folyamatok additív funkcionáljai.

Irodalom:

K.L. Chung, R. Williams: Introduction to stochastic integration. Second edition. Birkhäuser, 1989

N. Ikeda, S. Watanabe: Stochastic differential equations and diffusion processes. 2nd edition. North Holland, 1989

K. Ito, H.P. McKean: Diffusion processes and their sample paths. Springer, 1965

J. Jacod, S.N. Shiryaev: Limit theorems for stochastic processes. Springer, 1987

S. Karlin, H.M. Taylor: A second course in stochastic processes. Academic, 1981

D. Revuz, M. Yor: Continuous martingales and Brownian motion. 3rd edition. Springer, 1999

válogatott cikkek, előadó jegyzetei

Pénzügyi folyamatok, BMETE95MM14, 2/0/0/f/3

Diszkrét modellek: optimális parkolás, stratégia kedvező és kedvezőtlen helyzetben.

Önfinanszírozó stratégiák, arbitrázsmentes piacok, teljesség. Amerikai, európai, ázsiai opciók. Ismétlés: bináris modell, martingál módszer. Diszkrét modellben nem teljes piac árazása.

Black és Scholes elmélete: martingál mérték, Itô-féle reprezentációs tétel. Black-Scholes modell alkalmazásai, megengedett stratégiák.

Tőkeárazási modellek (CAPM). Portfóliók fajtái, értékpapírpiaci egyenes, tőkepiaci egyenes, piaci egyensúly, tőkepiaci egyensúly.

Opciók árazása GARCH modellekkel. Az optimális befektetések problémája. Extrémérték elmélet, maximumok eloszlása, rekordok eloszlása.

Irodalom:

J. Michael Steele, *Stochastic Calculus and Financial Applications*, Springer, New York, 2001.

Barry C. Arnold, N. Balakrishnan, H. N. Nagaraja, *Records*, John Wiley and Sons, 1998.

Fritz József: Pénzügyi matematika, kézirat

előadó jegyzetei, cikkek

Dinamikus programozás a pénzügyi matematikában, BMETE93MM14, 2/0/0/v/3

Optimális stratégiák, diszkrét modellek. A dinamikus programozás alapelve. Kedvezőtlen és kedvező játékok, merész és óvatos stratégiák. Optimális parkolás, nagybeszerzés tervezése. Lagrange mechanika, Hamilton-Jacobi egyenlet. Viszkózus közelítés, Hopf-Cole transzformáció, a Hopf-Lax féle infimum-konvolúciós formula. Determinisztikus optimális kontroll, optimális beruházás stratégiája, az általános Hamilton-Jacobi egyenlet viszkózus megoldásai. Pontrjagin maximum elve, feltételes szélsőérték keresése függvényterben. Sztochasztikus modellek optimális kontrollja, a Hamilton-Jacobi-Bellman egyenlet.

Irodalom:

Pénzügyi matematika, www.math.bme.hu/~jofri

L.C. Evans: Partial Differential Equations, AMS, Providence, R.I., 1998.

Extrémérték elmélet, BMETE95MM16, 2/0/0/v/3

Centrális határeloszlás tételek áttekintése, normális eloszlás vonzási tartománya, stabilis eloszlások, alfa-stabil eloszlások vonzási tartománya, Max-stabilis eloszlások, Fisher-Tippet tétel, Standard extrémérték eloszlások, Poisson approximáció, maximum vonzási tartománya, általános extrémérték eloszlások, reguláris változású függvények és tulajdonságaik, Frechet és Weibull eloszlások maximum vonzási tartományának karakterizációja. Gumbel eloszlás. Általánosított Pareto eloszlás. A többlet határeloszlása. Paraméter becslési módszerek, gazdasági, pénzügyi alkalmazások.

Irodalom:

A. J. McNeil, R. Frey, P. Embrechts: Quantitative Risk Management Princeton University Press, 2005.

B.C. Arnold, N. Balakrishnan, H.N.Nagaraja: Records John Wiley and Sons

Biztosításmatematika 2, BMETE95MM17, 2/0/0/f/3

- a) Biztosítási alaptípusok: Élet, nem élet ág. Nem élet biztosításon belül vagyon, felelősség, baleset, egészség.
- b) Egyéni kockázat modellje
 - Kárösszeg meghatározása, Normális közelítés
- c) Nevezetes kárszám eloszlások (Poisson, negatív binomiális stb.)
- d) Nevezetes káreloszlások (Exponenciális, gamma, Pareto, lognormális stb.)
- e) Összetett kockázat modellje
 - Panjer-rekurzió, Összetett Poisson eloszlások
- f) Díjkalkulációs elvek
 - Klasszikus díjelvek: várhatóérték elve, maximális veszteség elve, kvantilis elv, szórás, ill. szórásnégyzet elve
 - Átlagos érték elve
 - Elméleti díjelvek: zéró hasznosság elve, svájci díjkalkulációs elv, veszteségfüggvény elv.
- g) A díjkalkulációs elvek tulajdonságai (Várható érték túllépése, no-riporoff feltétel, Rendezés megtartás, Homogenitás, additivitás, eltolás invariancia, Iterálhatóság, szubadditivitás)
- h) Credibility elmélet. Bühlmann modell. Bühlmann–Straub modell. Tapasztalati díjszámítás.
- i) Bónusz rendszerek. Kármentességi díjvisszatérítések, engedmények. Bónusz-málusz rendszer.
- j) Tartalékszámítás. Meg nem szolgált díjak tartaléka, függőkár. IBNR, matematikai tartalék, kifutási háromszög stb.

Irodalom:

George E. Rejda: Principles of Risk Management and Insurance

Arató Miklós: Általános biztosításmatematika. ELTE jegyzet, 2000

Többváltozós statisztika gazdasági alkalmazásokkal, BMETE95MM18, 2/0/0/f/2

Többdimenziós Centrális Határeloszlás Tétel és alkalmazásai. A statisztikában használt véletlen mátrixok (Wishart-, Wigner-mátrixok) sűrűsége, spektruma és aszimptotikus eloszlása. Sajátértékekre és szinguláris értékekre vonatkozó szeparációs tételek alkalmazása a főkomponens-, faktor-, kanonikus korreláció- és korrespondanciaanalízisben. Faktoranalízis, mint alacsony rangú reprezentáció, reprezentáció és metrikus klaszterező eljárások kapcsolata. Klasszifikációs módszerek: diszkriminanciaanalízis, hierarchikus, k-közép és gráfelméleti módszerek a klaszteranalízisben. Gráfok spektruma és becsülhető paraméterfüggvényei.

Algoritmikus modellek, tanulóalgoritmusok. EM-, ACE-algoritmus, Kaplan–Meier-becslések. Újramintavételezési eljárások: bootstrap és jackknife. Adatbányászati alkalmazások, randomizált módszerek nagyméretű problémákra. A többváltozós statisztikai módszerek használatának és angol nevezéktanának elsajátítása egy programcsomag segítségével (SPSS vagy S+), output eredmények alkalmazásorientált elemzése.

Irodalom:

M. Bolla, A. Krámlí: Statisztikai következtetések elmélete, Typotex, Budapest, 2005

K. V. Mardia, J. T. Kent, J. M. Bibby: Többváltozós analízis (angolul), Academic Press, Elsevier Science, 1979, 2003

Közgazdasági idősorok elemzése, BMEGT30M0xx, 2/0/0/f/2

Rövid bevezetés után, a stúdiumok első részében, általánosítjuk a korábban már megismert hagyományos növekedési és konjunktúra-modelleket. Ennek során kitérünk olyan kérdésekre, mint a fejlődés finanszírozása, a humán tőke szerepe, a költségvetési deficit dinamikája, az endogén népességi növekedés, az egészség-gazdaságtan, a megújuló természeti erőforrások. Ezt követi az időinkonzisztencia problémájának a tárgyalása (mind a pénzpolitikában, mind a költségvetési politikában), amely – a különböző várakozások elemzésén keresztül – átvezet dinamikus játékelméleti megközelítésekhez. Ezzel lehetőség nyílik arra, hogy a makrogazdasági jelenségek mikroökonómiai megalapozását adjuk meg. A gazdasági evolúció modelljeinek a bemutatásával lezárjuk a kurzust.

Irodalom:

Dowrick, S., Pitchford, R., Turnovsky, S. (ed.): Economic Growth and Macroeconomic Dynamics. Cambridge University Press, Cambridge, 2004.

Huber, B.: Optimale Finanzpolitik und zeitliche Inkonsistenz. Physica-Verlag, Heidelberg, 1996.

Turnovsky, S.: Methods of Macroeconomic Dynamics, MIT Press, Cambridge (Mass.), 2000.

Vega-Redondo, F.: Evolution, Games, and Economic Behaviour. Oxford University Press, Oxford, 1996.

Idősorelemzések pénzügyi alkalmazásokkal, BMETE95MM26, 2/0/0/f/3

ARMA modellek, fehér zaj, eltolás operátor és polinomjai, autokorreláció, keresztkorreláció, autokovariancia, alapvető reprezentáció, állapotter reprezentáció, ARMA modellek előrejelzése, impulzus-válasz függvény, stacionárius ARMA modell, vektor autoregresszió(VAR), Sims és Blanchard-Quah ortogonalizáció, szórásfelbontás, VAR állapotterben, Granger okozat, spektrál reprezentáció, spektrálsűrűség, szűrők, szűrt sorok spektruma, szűrők konstruálása, Hodrick-Prescott szűrő, véletlen bolyongás, Beveridge-Nelson felbontás, Bayes-féle vektor autoregresszió (BVAR), Gibbs minták, kódolási gyakorlat és alkalmazásai pénzügyi valamint makroökonómiai adatokra.

Irodalom:

J. H. Cochran: Time Series for Macroeconomics and Finance,

Tusnády, Ziermann: Idősorok Elemzése,

J. D. Hamilton: Time Series Analysis.

Sztochasztika specializáció

Többváltozós statisztika, BMETE95MM15, 3/0/1/v/5

Többdimenziós Centrális Határeloszlás Tétel és alkalmazásai. A statisztikában használt véletlen mátrixok (Wishart-, Wigner-mátrixok) sűrűsége, spektruma és aszimptotikus eloszlása. Sajátértékekre és szinguláris értékekre vonatkozó szeparációs tételek alkalmazása a főkomponens-, faktor-, kanonikus korreláció- és korrespondanciaanalízisben. Faktoranalízis, mint alacsony rangú reprezentáció, reprezentáció és metrikus klaszterező eljárások kapcsolata. Klasszifikációs módszerek: diszkriminanciaanalízis, hierarchikus, k-közép és gráfelméleti módszerek a klaszteranalízisben. Gráfok spektruma és becslhető paraméterfüggvényei.

Algoritmikus modellek, tanulóalgoritmusok. EM-, ACE-algoritmus, Kaplan–Meier-becslések. Újramintavételezési eljárások: bootstrap és jackknife. Adatbányászati alkalmazások, randomizált módszerek nagyméretű problémákra. A többváltozós statisztikai módszerek használatának és angol nevezéktanának elsajátítása egy programcsomag segítségével (SPSS vagy S+), output eredmények alkalmazásorientált elemzése.

Irodalom:

Bolla, M., Krámlí, A.: Theory of statistical inference (in Hungarian), Typotex, Budapest, 2005

Mardia, K. V., Kent, J. T., Bibby, J. M.: Multivariate Analysis, Academic Press, Elsevier Science, 1979, 2003

Nemparaméteres statisztika, BMETE95MM20, 2/0/0/v/3

Sűrűségfüggvény-becslés: Eloszlásbecslés, L1 hiba. Hisztogram. Magfüggvényes becslés.

Regressziófüggvény-becslés.: Négyzetes hiba. Regressziófüggvény. Partíciós, magfüggvényes, legközelebbi szomszéd becslés. Empirikus hibaminimalizálás.

Alakfelismerés: Hibavalószínűség. Bayes döntés. Partíciós, magfüggvényes, legközelebbi szomszéd módszer. Empirikus hibaminimalizálás.

Portfólió-stratégiák: Log-optimalitás, empirikus portfólió-stratégiák. Tranzakciós költség.

Irodalom:

L. Devroye, L. Györfi: (1985) Nonparametric Density Estimation: the, Wiley. Russian translation: Mir, 1988

L. Devroye, L. Györfi, G. Lugosi: (1996) Probabilistic Theory of Pattern Recognition, Springer, New York

L. Györfi, M. Kohler, A. Krzyżak, H. Walk: (2002) A Distribution-Free Theory of Nonparametric Regression, Springer, New York

Statisztikai programcsomagok 2, BMETE95MM09, 0/0/2/f/2

A kurzus célja a statisztika modern számítógépes eszközeinek áttekintése a szükséges elméleti háttér ismertetésével.

1. SPSS használata program módban. Felhasználói programrészletek írása. A programok outputjainak értelmezése (az ott fellépő statisztikák jelentése és angol elnevezése) és ennek megfelelően a paraméterek beállítása.

2. S+ és R programcsomag használata és az SPSS-ben nem található új algoritmikus modellek áttekintése (bootstrap, jackknife, ACE).

3. Konkrét alkalmazás: Egy konkrét adatrendszer részletes elemzése S+-ban.

Irodalom:

K. V. Mardia, J. T. Kent, M. Bibby: Többváltozós analízis, angolul, Academic Press, New York, 1979

Ketskemény, L., Izsó, L., Bevezetés az SPSS programrendszerbe, ELTE Kiadó, Budapest, 2005
S+ vagy R Felhasználói útmutató (a programcsomaggal együtt letölthető)

Markov-folyamatok és martingálok, BMETE95MM07, 3/1/0/v/5

1. Martingálok: Ismétlés (Feltételes várható érték és toronyszabály, valószínűségi konvergencia-típusok és kapcsolataik, martingálok, megállított martingálok, Doob dekompozíció, kvadratikus variáció, maximál-egyenlőtlenségek, martingál konvergencia tételek, opcionális megállítási tétel, lokális martingálok). Martingálok konvergenciahalmazai, a négyzetesen integrálható eset. Alkalmazások (pl. Gambler's ruin, urnamodellek, szerencsejáték, Wald-azonosságok, exponenciális martingál). Martingál CHT, alkalmazások. Höföding–Azuma egyenlőtlenség és alkalmazásai (pl. utazó ügynök probléma)

2. Markov láncok: Ismétlés (definíciók, állapotok osztályozása, stacionárius eloszlás, reverzibilitás, tranziencia-(null-)rekurrencia). Elnyelési valószínűségek. Martingálok alkalmazásai, Markov-lánc CHT. Markov-láncok és dinamikai rendszerek; ergodtételek Markov-láncokra. Bolyongások és elektromos áramkörök.

3. Felújítási folyamatok: Laplace transzformált, konvolúció. Felújítási folyamat, felújítási egyenlet. Felújítási tételek, regeneratív folyamatok. Stacionárius felújítás, felújítási paradoxon. Sorbanállási alkalmazások

4. Pontfolyamatok: Pontfolyamatok definíciója. Poisson pontfolyamat egy és több dimenzióban. Poisson folyamat transzformációi (jelölés és ritkítás, transzformálás függvénnel, alkalmazások). Poisson pontfolyamatból származtatott pontfolyamatok

5. Diszkrét állapotterű Markov-folyamatok: Ismétlés (generátor, kapcsolat Markov-láncokkal, Kolmogorov előre és hátra egyenlet, állapotok osztályozása, tranziencia-(null-)rekurrencia, stacionárius eloszlás). Reverzibilitás, MCMC. Abszorpciós valószínűségek és elérési idők. Martingálok alkalmazásai (pl. ugró folyamatok kompenzátora). Markov-folyamatok és dinamikai rendszerek; ergodtételek Markov-folyamatokra. Lokálisan diszkrét állapotterű Markov-folyamatok: generátor tesztfüggvényeken

Irodalom:

Karlin, S.; Taylor, H. M.: Sztochasztikus folyamatok. Gondolat Kiadó, 1985 Budapest

Lindvall, T.: Lectures on the Coupling Method. Dover Publications, Inc., Mineola, NY, 2002.

Norris, J. R.: Markov chains. Cambridge University Press, Cambridge, 1998.

Resnick, S.: Adventures in Stochastic Processes. Birkhäuser Boston, 1992.

Rosenblatt, M.: Markov processes. Structure and Asymptotic Behavior. Springer-Verlag, New York-Heidelberg, 1971.

Williams, D.: Probability with Martingales. Cambridge University Press, 1991.

Sztochasztikus differenciálegyenletek BMETE95MM08 3/1/0/v/5

Előkövetelmény:

Sztochasztikus analízis és alkalmazásai ÉS Markov-folyamatok és martingálok

Bevezetés, ismétlés: Ito-integrál Wiener-folyamat szerint, integrálás folytonos martingál szerint, többdimenziós sztochasztikus integrál.

Lokális idő: Egydimenziós bolyongás lokális ideje, inverz lokális idő, diszkrét Ray–Knight-tétel. Egydimenziós Brown-mozgás lokális ideje és a folytonos Ray–Knight-tétel. Tanaka-formula és alkalmazásai. Szkorohod-tükrözés, tükrözött Brown-mozgás, P. Lévy egy tétele.

Sztochasztikus differenciálegyenletek: A diffúziós alappéldák (Ornstein–Uhlenbeck, Bessel, Bessel-squared, exponenciális Brown) SDE-i. Transzformált diffúzió SDE-je. Gyenge és erős megoldások, létezés, egyértelműség, nem-egyértelműség. Peremfeltételek és az infinitezimális generátor

pontos értelmezése. Sztochasztikus differenciálegyenletek alkalmazásai fizikában, populáció dinamikában, gazdaságtudományban.

Diffúziók: Alappéldák: Ornstein–Uhlenbeck-, Bessel-, Bessel-squared-folyamatok, geometriai Brown-mozgás. Diffúziók, mint sztochasztikus integrálok és mint Markov-folyamatok. Infinitezimális generátor, sztochasztikus félcsoport. A martingál-probléma. Kapcsolat parabolikus és elliptikus parciális differenciálegyenletekkel. Feynman–Kac-formula. Idő-csere és Cameron–Martin–Girszanov-formula.

Egydimenziós diffúziók sajátosságai: Skála-függvény és sebesség-mérték. Peremfeltételek egy pontban. Idő-megfordítás. Alkalmazások konkrét folyamatokra.

Speciális kiegészítő fejezetek: Brownian excursion, kétdimenziós Brown-mozgás, SLE, Markov-folyamatok additív funkcionáljai.

Irodalom:

K.L. Chung, R. Williams: Introduction to stochastic integration. Second edition. Birkhäuser, 1989

N. Ikeda, S. Watanabe: Stochastic differential equations and diffusion processes. 2nd edition. North Holland, 1989

K. Ito, H.P. McKean: Diffusion processes and their sample paths. Springer, 1965

J. Jacod, S.N. Shiryaev: Limit theorems for stochastic processes. Springer, 1987

S. Karlin, H.M. Taylor: A second course in stochastic processes. Academic, 1981

D. Revuz, M. Yor: Continuous martingales and Brownian motion. 3rd edition. Springer, 1999
válogatott cikkek, előadó jegyzetei

Pénzügyi folyamatok, BMETE95MM14, 2/0/0/f/3

Diszkrét modellek: optimális parkolás, stratégia kedvező és kedvezőtlen helyzetben.

Önfinanszírozó stratégiák, arbitrázsmentes piacok, teljesség. Amerikai, európai, ázsiai opciók. Ismétlés: bináris modell, martingál módszer. Diszkrét modellben nem teljes piac árazása.

Black és Scholes elmélete: martingál mérték, Itô-féle reprezentációs tétel. Black-Scholes modell alkalmazásai, megengedett stratégiák.

Tőkeárazási modellek (CAPM). Portfóliók fajtái, értékpapírpiaci egyenes, tőkepiaci egyenes, piaci egyensúly, tőkepiaci egyensúly.

Opciók árazása GARCH modellekkel. Az optimális befektetések problémája. Extrémérték elmélet, maximumok eloszlása, rekordok eloszlása.

Irodalom:

J. Michael Steele, *Stochastic Calculus and Financial Applications*, Springer, New York, 2001.

Barry C. Arnold, N. Balakrishnan, H. N. Nagaraja, *Records*, John Wiley and Sons, 1998.

Fritz József: Pénzügyi matematika, kézirat
előadó jegyzetei, cikkek

Határeloszlás- és nagy eltérés tételek, BMETE95MM10, 3/1/0/v/5

1. Határeloszlás-tételek: Valószínűségi mértékek és eloszlások gyenge konvergenciája Feszesség: Helly-Prohorov-tétel. Határeloszlás-tételek pusztá kézzel: Tükrözési elv alkalmazása bolyongásra: Paul Lévy arcussinus tételei, maximum, lokális idő és első elérések határeloszlása. Független és azonos eloszlású valószínűségi változók maximumának határeloszlása, extrémális eloszlások. Határeloszlás-tétel a szelvénygyűjtő (coupon collector) problémájára. Határeloszlás-tétel bizonyítása momentum-módszerrel. Határeloszlás-tétel bizonyítása karakterisztikus függvény módszerével. Lindeberg-tétel alkalmazásai. Erdős–Kac-tétel: CHT a prímosztók számára. Stabilis eloszlások. Szimmetrikus stabilis eloszlások karakterisztikus függvényeinek jellemzése. Konvergencia szimmetrikus stabilishoz. Alkalmazások. Általános (nem szimmetrikus) stabilis eloszlás karakterisztikus függvényének jellemzése, ferdeség. Határeloszlás-tétel nem szimmetrikus esetben.

Korlátlanul osztható eloszlások: Lévy–Hincsin-formula, Lévy-mérték. Poisson pont folyamatok és kapcsolatuk korlátlanul osztható eloszlásokkal. Korlátlanul osztható eloszlások mint szériasorozatok határeloszlása. Alkalmazások.

Lévy-folyamatok – bevezetés: Lévy–Hincsin formula és a folyamatok felbontása. Pozitív (növekvő, szubordinátor) és korlátos változású Lévy-folyamatok. Stabilis folyamatok. Példák és alkalmazások. 2. Nagy eltérés tételek: Bevezetés: Ritka események és nagy eltérések, nagy eltérés elv (LDP), nagy eltérések számolása pusztá kézzel (Stirling-formulával).

Kombinatorikus módszerek: Típusok módszere, Szanov-tétel véges abc-re.

Nagy eltérés tételek véges dimenzióban: Bernstein-egyenlőtlenség, Chernov-korlát. Cramer-tétel. Konvex analízis elemei, konvex konjugálás véges dimenzióban, Cramer tétel \mathbb{R}^d -ben. Gartner–Ellis-tétel. Alkalmazások: nagy eltérés tételek bolyongásokra, véges állapotterű Markov-láncok trajektóriájának empirikus eloszlására, statisztikai alkalmazások.

Általános elmélet: Nagy eltérés elvek általában. Kontrakciós elv és Varadhan-lemma. Nagy eltérések topologikus vektorterekben, függvényterekben, absztrakt konvex analízis. Alkalmazások: Schilder-tétel, Gibbs feltételes mérték és statisztikus fizika elemei.

Irodalom:

A. Dembo, O. Zeitouni: Large deviation techniques and application. Springer, 1998

R. Durrett: Probability: theory and examples. Second edition. Duxbury, 1996

B.V. Gnedenko, A.N. Kolmogorov: Független valószínűségi változók összegeinek határeloszlásai

W. Feller: An introduction to probability theory and its applications. Vol.2. Wiley, 1970

D.W. Stroock: An introduction to the theory of large deviations. Springer, 1984

S.R.S. Varadhan: Large deviations and applications. SIAM Publications, 1984

D. Williams: Probability with martingales. Cambridge UP, 1990

Cikkek, előadók jegyzetei

Sztochasztikus modellek, BMETE95MM11, 2/0/0/f/2

Csatolásos módszerek (sztochasztikus dominancia, val. változók és folyamatok csatolásai, példák: átjárhatóság duális gráffal, optimalizálási problémák, kombinatorikus valószínűségi feladatok). Perkoláció (definíciók, korrelációs egyenlőtlenségek, dualitás, kontúr módszerek). Erősen függő perkoláció: Winkler perkoláció, kompatibilis 0-1 sorozatok. Statisztikus fizika alapjai (Gibbs mérték, néhány alapmodell). Kártyakeverések (teljesen kevert pakli, hányszor kell egy paklit megkeverni?). Véletlen gráfmodellek (Erdős–Rényi, Barabási–Albert; alapjelenségek). Bolyongások változatai: scenery reconstruction, self-avoiding és self-repelling bolyongás, loop-erased bolyongás, bolyongás véletlen közegben. Sorbanállási modellek és azok alaptulajdonságai; stacionárius eloszlás és reverzibilitás, Burke-tétel; sorbanállási rendszerek. Kölcsönható részecske-rendszerek (simple exclusion tóruszon és végtelen rácson, egyensúlyi eloszlás, Palm-eloszlások, csatolások, egyéb rendszerek). Folytonos idejű Markov-folyamatok grafikus konstrukciója (Yule modell, Hammersley folyamat, részecske-rendszerek). Önszervező kritikusság: homokszem-modellek (konstrukció kérdései, a dinamika kommutatív tulajdonsága, egyensúly véges térfogatban, korreláció hatványlecsengése). Stacionárius folyamatok lineáris elmélete: erősen és gyengén stacionárius folyamatok, spektrális tulajdonságok, autoregressziós és mozgó átlag folyamatok. Idősorok elemzése, hosszúmemóriájú folyamatok. Kockázati folyamatok modelljei.

Irodalom (válogatott fejezetek az alábbi – és további – művekből):

Grimmett, G.: Percolation. Springer-Verlag, Berlin, 1999.

Liggett, T.: Interacting Particle Systems. Springer-Verlag, Berlin, 2005.

Lindvall, T.: Lectures on the Coupling Method. Dover Publications, Inc., Mineola, NY, 2002.

Thorisson, H.: Coupling, Stationarity, and Regeneration. Springer-Verlag, New York, 2000.

Walrand, J.: An Introduction to Queueing Networks. Prentice Hall 1988

Werner, W.: Lectures on Two-dimensional Critical Percolation, <http://arxiv.org/abs/0710.0856>

Werner, W.: Random Planar Curves and Schramm–Loewner Evolutions,

<http://arxiv.org/abs/math/0303354>

Zeitouni, O.: Lecture Notes on Random Walks in Random Environment, XXXI summer school in probability, St Flour, France, Volume 1837 of Springer's Lecture notes in Mathematics

Haladó dinamikai rendszerek, BMETE95MM12, 2/0/0/f/2

Szubadditív és multiplikatív ergodtételek. Lyapunov exponensek. Mértéktartó leképezések spektrális tulajdonságai. Shadowing lemma. Markov felbontások és konstrukcióik egyenletesen hiperbolikus rendszerekre. Perron–Frobenius operátor és spektruma. Doeblin–Fortet egyenlőtlenség. Hiperbolikus dinamikai rendszerek sztochasztikus tulajdonságai. Kolmogorov–Sinai entrópia. Ornstein izomofia tétele (bizonyítás nélkül).

Irodalom:

M. Pollicott: Lectures on Ergodic theory and Pesin Theory on compact manifolds, CUP, 1993

R. Bowen: Equilibrium states and the ergodic theory of Anosov diffeomorphisms. Springer LNM 470, 1975

M. Brin-G. Stuck: Introduction to Dynamical Systems. CUP, 2002

Egyéb közös tárgyak

Témalabor 1, 2, BMETE92MM01, 0/0/4/f/4, BMETE92MM02 0/0/4/f/4

A tárgy keretében a hallgató külső témavezető által meghirdetett, alkalmazás orientált sztochasztikus matematikát alkalmazó témán dolgozik, a témavezető irányításával. Minden félév végén beszámolót készít a hallgató az eredményeiről, melyet előadás formájában a társainak bemutat. A tárgy során begyakorolandó tevékenységek: irodalmazás, modellezés, számítógéppel segített feladatmegoldás, matematikai problémamegoldás.

Matematikai modellalkotás szeminárium 1, 2

BMETE95MM01, 2/0/0/f/1 BMETE95MM02, 2/0/0/f/1

A szeminárium célja rendszeres fórumot biztosítani alkalmazott matematikai eredmények, modellek és problémák bemutatására, és ezzel elősegíteni

(i) a Matematika Intézetben belül és szélesebb körben is, az alkalmazott matematikai ismeretek és kultúra elterjesztését;

(ii) fejleszteni egyfelől a Matematika Intézet oktatói és diákjai, másfelől más intézmények, intézetek (a BME több tanszékét, intézetét is ideértve), cégek, vállalatok matematika iránt fogékony munkatársaival való kapcsolattartást, együttműködést.

A szemináriumra hétről hétre meghívunk egy-egy előadót, aki a munkája során felmerülő matematikai problémáról beszél. Általában két típusú előadó van: matematikus, aki alkalmazott matematikusként dolgozik, illetve nem matematikus, de munkája során matematikai problémák merülnek fel. A korábbi évek gyakorlatához hasonlóan széles palettát kívánunk nyújtani a témákat illetően; előadókat hívunk meg a BME különböző tanszékeiről, a SZTAKI-ból, bankokból, a távközlés területéről, és egyéb piaci cégtől (bővebben lásd a szeminárium honlapján:

www.math.bme.hu/~gnagy/mmsz/mmsz.htm).

A hallgatóinknak előírjuk a matematikai modellalkotás szeminárium látogatását, hogy ezzel is plasztikus képet nyerjenek szakmájuk lehetséges alkalmazásairól. A szeminárium előadásai általá-

ban érthetőek lesznek ezen hallgatóink számára, akik ekkor már túl vannak az igen sokoldalú alapképzésen. Alkalmazott matematikai témáknál természetesen különösen fontos a problémafelvetés motivációja, a modellalkotás bemutatása és annak illusztrálása, a javasolt megoldás mennyire segít a felmerült problémában. Az előadások után a hallgatóknak lehetőségük van kérdéseikkel további ismereteket szerezni a bemutatott témáról, illetve az előadó munkásságáról.

Az előadások egy másik célja, hogy az érdeklődő hallgatók esetleg valamilyen formában bekapcsolódhatnak a munkába, ezzel is elősegítve a hosszabbtávú érvényesülésüket, hogy az egyetem elvégzése után könnyebben jussanak álláslehetőséghez.

Diplomamunka

Beszámoló, BMETE90MM90, 0/0/0/a/0

A tárgyat akkor tekintjük teljesítettnek (aláírás akkor adható), ha

- a hallgató a felvételi során megkövetelt alapképzésbeli tárgyak elvégzésével az előírt legalább 65 kreditet teljesítette.
- a hallgatónak van elfogadott diplomatémája és témavezetője.

Diplomamunka előkészítés, BMETE90MM98, 0/2/0/f/5

Előkövetelmény: **Beszámoló**

A diplomamunka a matematikushallgatóknak a témavezető irányításával elért önálló kutatási, kutatás-fejlesztési eredményeit tartalmazó írásbeli beszámoló (dolgozat).

A Diplomamunka 1 tárgy keretében a hallgató összegyűjti mindazokat az információkat és matematikai eredményeket, amelyek a diplomamunka megírásához szükségesek.

Diplomamunka-készítés, BMETE90MM99, 0/8/0/zv/15

Előkövetelmény: **Diplomamunka előkészítés**

A tárgy keretében a hallgató megírja a diplomamunkáját.

A hallgató a dolgozatban mutassa be a vizsgált témát, fejtse ki a problémákat, és részletesen ismeresse eredményeit. A munkának a matematikus tanulmányok ismeretanyagára kell épülnie és a szerző önálló, saját munkája legyen.

A diplomamunkának arról kell tanúskodnia, hogy a hallgató az egyetemi tanulmányai során szerzett matematikai ismereteit, képességeit a gyakorlati életben vagy az elméleti kutatásokban egy több hónapra kiterjedő munka folyamán önállóan tudja alkalmazni oly módon, hogy a megoldandó problémát felismeri, a megoldáshoz vezető út nehézségeivel megbirkózik, a megfelelő színvonalú megoldást megtalálja, és azt mások számára érthetően leírja. A dolgozat legyen tömör, de a témában nem járatos matematikus olvasó számára is érthető.

A Diplomamunka-készítés tantárgy aláírását a témavezető vagy kari bíráló bizottság, külső témavezető esetén a belső konzulens vagy kari bíráló bizottság adja, érdemjegyét – a beadott és elbírált diplomamunka alapján – a záróvizsga bizottság állapítja meg.

A záróvizsga két részből áll:

1. A hallgató a záróvizsga első részében ismerteti diplomamunkáját, válaszol a témavezető, a bíráló, illetve a Záróvizsga Bizottság által feltett kérdésekre, kifogásokra, hozzászólásokra. A diplomamunka osztályzatát a témavezető és a bíráló javaslata alapján, valamint a vizsgán elhangzottak figyelembevételével a Záróvizsga Bizottság állapítja meg.

2. A záróvizsga második részében a hallgató szóbeli vizsgát tesz az általa választott záróvizsga témakörökből, amelyek megfelelnek a matematika nagy szakterületeinek. Ezek tematikáját a Matematikus Szakbizottság hagyja jóvá.

A záróvizsga menetének szabályai és követelményei az Egyetem Tanulmányi és Vizsgaszabályzatában, illetve Képzési Kódexében vannak rögzítve.

A TERMÉSZETTUDOMÁNYI KAR VEZETÉSE ÉS HALLGATÓI KÉPVISELETE

A Dékáni Hivatalának címe: 1111 Budapest, Műegyetem rkp. 3. K. épület I. em. 18.

Dékán: DR. PIPEK JÁNOS egyetemi docens

Dékánhelyettesek:

Gazdasági: DR. VARGA IMRE egyetemi docens

Nemzetközi és tudományos: DR. KÁROLYI GYÖRGY egyetemi tanár

Oktatási: DR. PROK ISTVÁN egyetemi docens

Dékáni Hivatal:

Hivatalvezető: ADAMIS-SZÉL VIKTÓRIA

Titkárság: Telefon: 463-3561, Fax: 463-3560

Gazdasági csoport: Telefon: 463-3756

Tanulmányi csoport: Telefon: 463-1919

Kari Hallgatói Képviselő

Elnök: KOVÁCS SZILVIA

Cím: 1111 Budapest, Irinyi J. u. 9-11,
Kármán Tódor Kollégium F013.

Telefon: 06-20-435-2482

E-mail: hk@wigner.bme.hu

Web: <http://hk.wigner.bme.hu>

Kari lap: *Pikkász*:

Főszerkesztő: BUNTH GERGELY

Szerkesztőség: 1111 Budapest, Irinyi J. u. 9-11,
Kármán Tódor Kollégium F013.

E-mail: pikkasz@lists.ktk.bme.hu

Web: <http://karilap.blogspot.com>

A TERMÉSZETTUDOMÁNYI KAR INTÉZETEI ÉS TANSZÉKEI

Fizikai Intézet – igazgató: DR. ZARÁND GERGELY, egyetemi tanár

1111 Budapest, Budafoki út 8. F épület, III. lh., mf. 5.

Telefon: 463-4107, Fax: 463-3567

Atomfizika Tanszék – tanszékvezető: DR. KOPPA PÁL egyetemi tanár

1111 Budapest, Budafoki út 8. F épület, III. lh., mf. 44.

Telefon: 463-4193, Fax: 463-4194

Elméleti Fizika Tanszék – tanszékvezető: DR. SZUNYOGH LÁSZLÓ egyetemi tanár

1111 Budapest, Budafoki út 8. F épület, III. lh., mf. 5.

Telefon: 463-4107, Fax: 463-3567

Fizika Tanszék – tanszékvezető: DR. HALBRITTER ANDRÁS egyetemi docens

1111 Budapest, Budafoki út 8. F épület, III. lh., II. em. 16.

Telefon: 463-2312, Fax: 463-4180

Kognitív Tudományi Tanszék – tanszékvezető: DR. LUKÁCS ÁGNES egyetemi docens

1111 Budapest, Egry József utca 1. T épület, V. em. 506.

Telefon: 463-1273, Fax: 463-1072

Matematika Intézet – igazgató: DR. HORVÁTH MIKLÓS egyetemi tanár

1111 Budapest, Egry József utca 1. H épület, III. em. 312.

Telefon: 463-2762, Fax: 463-2761

Algebra Tanszék – tanszékvezető: DR. NAGY ATTILA, egyetemi docens

1111 Budapest, Egry József utca 1. H épület, V. em. 504.

Telefon: 463-2094, Fax: 463-1780

Analízis Tanszék – tanszékvezető: DR. HORVÁTH MIKLÓS egyetemi tanár

1111 Budapest, Egry József utca 1. H épület, II. em. 25.

Telefon: 463-2324, Fax: 463-3172

Differenciálegyenletek Tanszék – tanszékvezető: DR. ILLÉS TIBOR egyetemi docens

1111 Budapest, Egry József utca 1. H épület, IV. em. 42.

Telefon: 463-2140, Fax: 463-1291

Geometria Tanszék – tanszékvezető: DR. G. HORVÁTH ÁKOS egyetemi docens

1111 Budapest, Egry József utca 1. H épület, II. em. 22.

Telefon: 463-2645, Fax: 463-1050

Sztochasztika Tanszék – tanszékvezető: DR. SIMON KÁROLY egyetemi tanár

1111 Budapest, Egry József utca 1. H épület, V. em. 507.

Telefon: 463-1101, Fax: 463-1677

Nukleáris Technikai Intézet – igazgató: DR. CZIFRUS SZABOLCS egyetemi docens

1111 Budapest, Műegyetem rkp. 7-9. R épület, III. em. 317/2/B

Telefon: 463-2523, Fax: 463-1954

Atomenergetika Tanszék – tanszékvezető: DR. SZALÓKI IMRE egyetemi docens

1111 Budapest, Műegyetem rkp. 7-9. R épület, III. em. 317/2/B

Telefon: 463-2523, Fax: 463-1954

Nukleáris Technika Tanszék – tanszékvezető: DR. CZIFRUS SZABOLCS egyetemi docens

1111 Budapest, Műegyetem rkp. 7-9. R épület, III. em. 317/2/B

Telefon: 463-2523, Fax: 463-1954