

SEMINARIO DE PROCESOS ESTOCÁSTICOS

Programa

- 1- Definición y clasificación de Procesos Estocásticos.
- 2- Cadenas de Markov. Distribución inicial y funciones de transición. Descomposición del espacio de estados. Distribuciones estacionarias.
- 3- Procesos de Markov a tiempo continuo. Procesos de nacimiento y muerte. Procesos de Poisson. Clasificación de estados.
- 4- Procesos de segundo orden. Funciones de medias y de covarianzas. Procesos gaussianos. Procesos de Wiener. Continuidad, derivación e integración de procesos.
- 5- Ecuaciones diferenciales estocásticas. Teoría de estimación.

Bibliografía

HOEL, P.G.; S.C. PORT; C.J. STONE: Introduction to stochastic processes. Houghton Mifflin, Boston, 1972,203pp

KARLIN, S.; H.M. TAYLOR: A first course in stochastic processes. Academic Press, New York, 1975,557pp

KARLIN, S.; H.M. TAYLOR: A second course in stochastic processes. Academic Press, New York, 1981,542pp

Código: 5926

Correlativa: Probabilidad y Estadística - **Aprobada**

Profesor: **Dra. Ana Tablar**

Email: atablar@criba.edu.ar

