



UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARÁ
INSTITUTO DE CIÊNCIAS EXATAS E NATURAIS
PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM MATEMÁTICA E ESTATÍSTICA

Ementa de Disciplina

Nome: Processos Estocásticos
Código: PPGME0105
Crédito: 04
Carga Horária: 60 horas
Ementa: Introdução e Fundamentos. Construção de Cadeias de Markov. Medidas Invariantes. Perda de Memória e convergência ao equilíbrio. Estudo de alguns Processos Especiais; Poisson, Nascimento e Morte, Ramificação, Renovação, Processos Markovianos de Salto, Processos de Difusão.
Bibliografia: <ol style="list-style-type: none">1. FERRARI, P.; GALVES, J.A. <i>Acoplamento e Processos Estocásticos</i>.2. KARLIN y TAYLOR. <i>A first course in stochastic processes</i>. 2 ed. New York, Academic Press, 1975.3. ROSS, S.M. <i>Applied probability models with optimization applications</i>. San Francisco, Holden-Day, 1970.4. FELLER, W. <i>An introduction to probability theory and its applications</i>.5. Artigos em www.periodicos.capes.gov.br e outros sites.