



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

Ementa de Disciplina

<b>Nome: Processos Estocásticos</b>
<b>Código: PPGME0105</b>
<b>Crédito: 04</b>
<b>Carga Horária: 60 horas</b>
<b>Ementa:</b> 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.
<b>Bibliografia:</b> <ol style="list-style-type: none"><li>1. FERRARI, P.; GALVES, J.A. <i>Acoplamento e Processos Estocásticos</i>.</li><li>2. KARLIN y TAYLOR. <i>A first course in stochastic processes</i>. 2 ed. New York, Academic Press, 1975.</li><li>3. ROSS, S.M. <i>Applied probability models with optimization applications</i>. San Francisco, Holden-Day, 1970.</li><li>4. FELLER, W. <i>An introduction to probability theory and its applications</i>.</li><li>5. Artigos em <a href="http://www.periodicos.capes.gov.br">www.periodicos.capes.gov.br</a> e outros sites.</li></ol>