

Processos Estocàstics.



Programa:



1. Introducció
2. Cadenes de Markov.
3. El procés de Poisson.
4. Sèries temporals.
5. El procés de Wiener.



Bibliografia:

- Feller: "Introducción a la teoría de Probabilidades y sus aplicaciones (vol I)". Limusa (1993)
- Fuller: "Introduction to Statistical Time Series". Wiley (1976)
- D. Peña: "Estadística: modelos y metodos" (vol II). Alianza Universidad (1994).
- K. Chung: "Teoría elemental de la probabilidad y de los procesos estocásticos". Reverté.
- S. M. Ross: "Applied Probability Models with Optimization Applications". Dover (1992).
- S. M. Ross: "Stochastic Processes (2nd ed.)". Wiley (1996).