**Nazwa przedmiotu:**

Procesy stochastyczne

**Koordynator przedmiotu:**

prof. dr hab. Jolanta Misiewicz

**Status przedmiotu:**

Fakultatywny ograniczonego wyboru

**Poziom kształcenia:**

Studia I stopnia

**Program:**

Matematyka

**Grupa przedmiotów:**

Wspólne

**Kod przedmiotu:**

**Semestr nominalny:**

6 / rok ak. 2011/2012

**Liczba punktów ECTS:**

5

**Liczba godzin pracy studenta związanych z osiągnięciem efektów uczenia się:**

**Liczba punktów ECTS na zajęciach wymagających bezpośredniego udziału nauczycieli akademickich:**

**Język prowadzenia zajęć:**

polski

**Liczba punktów ECTS, którą student uzyskuje w ramach zajęć o charakterze praktycznym:**

**Formy zajęć i ich wymiar w semestrze:**

|  |  |
| --- | --- |
| Wykład: | 30h |
| Ćwiczenia: | 30h |
| Laboratorium: | 0h |
| Projekt: | 0h |
| Lekcje komputerowe: | 0h |

**Wymagania wstępne:**

Rachunek prawdopodobieństwa, Analiza matematyczna

**Limit liczby studentów:**

**Cel przedmiotu:**

do uzupełnienia

**Treści kształcenia:**

1. Podstawowe definicje i klasyfikacja procesów stochastycznych, pojęcie trajektorii, parametry liczbowe dla procesów drugiego rzędu..
2. Łańcuchy Markowa: prawdopodobieństwa przejścia, klasyfikacja stanów, okresowość i powracalność stanów, stacjonarność i ergodyczność, przykłady zastosowania łańcuchów Markowa.
3. Proces Poissona: podstawowe własności, bezpośrednia konstrukcja, złożony proces Poissona, poissonowskie pole losowe, warunkowy proces Poissona.
4. Łańcuchy Markowa z czasem ciągłym: czysty proces urodzin, proces urodzin i śmierci, problemy eksplozji demograficznej i wymarcia populacji.
5. Ogólne własności procesów: twierdzenie Kołmogorowa o istnieniu procesu o zadanych rozkładach, stochastyczna równoważność procesów, twierdzenia o istnieniu wersji ośrodkowych i cadlag dla procesów Levy’ego.
6. Proces Wienera: definicja i podstawowe własności, nierówność Levy’ego i zasada odbicia, ciągłość trajektorii i nieróżniczkowalność, konstrukcja Ciesielskiego, lokalne i globalne prawo iterowanego logarytmu, prawdopodobieństwo przejścia.
7. Procesy Markowa: rozkłady nieskończenie podzielne i markowska funkcja przejścia, istnienie wersji o ciągłych trajektoriach.

**Metody oceny:**

Zaliczenie ćwiczeń na podstawie obecności, aktywności i wyników kartkówek, które będą przeprowadzane na każdych zajęciach. Do zaliczenia potrzebna jest połowa możliwych do uzyskania z kartkówek punktów. Aktywnością na zajęciach można odrobić ewentualne stracone na kartkówkach punkty. Do egzaminu przystępują wszyscy.
Egzamin składa się z testu, zadań i pytań teoretycznych. Do uzyskania zaległego zaliczenia ćwiczeń należy uzyskać 65 % punktów z testu. Na ocenę składa się liczba punktów uzyskana na egzaminie w 70 % oraz liczba punktów uzyskana w ciągu semestru na ćwiczeniach w 30 %.

**Egzamin:**

**Literatura:**

1. A. Iwanik i J. Misiewicz, Wykłady z procesów stochastycznych z zadaniami. Część pierwsza: procesy Markowa. Podręcznik akademicki – Wydawnictwo Uniwersytetu Zielonogórskiego, 2009.
2. A. Plucińska i E. Pluciński, Probabilistyka, WNT, Warszawa, 2000.
3. J. Jakubowski i R. Sztencel, Wstęp do teorii prawdopodobieństwa, Script, Warszawa, 2000.

**Witryna www przedmiotu:**

**Uwagi:**

## Efekty przedmiotowe