**Nazwa przedmiotu:**

Procesy stochastyczne

**Koordynator przedmiotu:**

dr Jarosław Sobczyk, st. wykł., Wydział Matematyki i Nauk Informacyjnych, Zakład Procesów Stochastycznych i Matematyki Finansowej

**Status przedmiotu:**

Fakultatywny ograniczonego wyboru

**Poziom kształcenia:**

Studia II stopnia

**Program:**

Transport

**Grupa przedmiotów:**

Obieralne

**Kod przedmiotu:**

BRAK DANYCH

**Semestr nominalny:**

2 / rok ak. 2012/2013

**Liczba punktów ECTS:**

2

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

58 godzin, w tym: praca na wykładach: 15 godz., praca na ćwiczeniach: 15 godz., studiowanie literatury przedmiotu: 10 godz., konsultacje: 3 godz., przygotowanie do zaliczenia przedmiotu: 15 godz.

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

1,5 pkt. ECTS (33 godziny, w tym: praca na wykładach: 15 godz., praca na ćwiczeniach: 15 godz., konsultacje: 3 godz.)

**Język prowadzenia zajęć:**

polski

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

0

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

|  |  |
| --- | --- |
| Wykład:  | 15h |
| Ćwiczenia:  | 15h |
| Laboratorium:  | 0h |
| Projekt:  | 0h |
| Lekcje komputerowe:  | 0h |

**Wymagania wstępne:**

Posiada wiedzę z zakresu analizy matematycznej i rachunku prawdopodobieństwa na poziomie wymaganym na studiach I stopnia

**Limit liczby studentów:**

wykład: brak, ćwiczenia: 30 osób

**Cel przedmiotu:**

Nabycie wiedzy i umiejętności w zakresie jednowymiarowych procesów stochastycznych oraz ich zastosowań w technice. Wykształcenie umiejętności rozwiązywania elementarnych problemów opisywanych za pomocą procesów stochastycznych.

**Treści kształcenia:**

Wykład: definicja rzeczywistego procesu stochastycznego, warunki zgodności oraz twierdzenie Kołmogorowa o istnieniu procesu, podstawowe parametry liczbowe procesów stochastycznych, ośrodkowość procesu stochastycznego, procesy o przyrostach niezależnych, proces Poissona, procesy normalne, proces Wienera (proces ruchu Browna), proces Ornsteina-Uhlenbecka, procesy stacjonarne – przykłady, własność Markowa, funkcja prawdopodobieństwa przejścia, równanie Chapmana-Kołmogorowa, procesy Markowa o przeliczalnej przestrzeni stanów i czasie dyskretnym, macierz prawdopodobieństw przejścia, proces błądzenia losowego, procesy Markowa o przeliczalnej przestrzeni stanów i czasie ciągłym, równania Kołmogorowa dla rozkładu jednowymiarowego i dla prawdopodobieństwa przejścia, proces urodzin i śmierci, procesy dyfuzji oraz ich własności i zastosowania.
Ćwiczenia: wyznaczanie wartości oczekiwanej, funkcji kowariancji oraz wariancji dla wybranych procesów stochastycznych, badanie własności procesu Poissona i procesu Wienera, stwierdzanie własności stacjonarności procesu (w węższym i szerszym sensie), przykłady, sprawdzanie własności Markowa dla wybranych procesów, wyznaczanie postaci funkcji prawdopodobieństwa przejścia, wyznaczanie macierzy prawdopodobieństw przejścia dla procesów Markowa o przeliczalnej przestrzeni stanów dla dowolnej liczby kroków, zastosowanie równań Kołmogorowa do wyznaczania rozkładów stacjonarnych procesów ze szczególnym uwzględnieniem procesu Poissona i procesu urodzin i śmierci, zastosowania procesów dyfuzji do modelowania zagadnień technicznych.

**Metody oceny:**

Wykład: kolokwium pisemne, 3 pytania, wymagane jest uzyskanie ponad 50% punktów; Ćwiczenia: obecności i kolokwium pisemne, 2 zadania otwarte, wymagane jest uzyskanie ponad 50% punktów.

**Egzamin:**

nie

**Literatura:**

1) Plucińska A., Pluciński E., Probabilistyka, WNT, Warszawa 2000;
2) Sobczyk K., Stochastyczne równania stochastyczne, WNT, Warszawa 1996;
3) Wentzell A.D., Wykłady z procesów stochastycznych, PWN, Warszawa 1980.

**Witryna www przedmiotu:**

www.wt.pw.edu.pl

**Uwagi:**

Przedmiot oferowany w grupie przedmiotów obieralnych dla modułu "Wybrane działy matematyki stosowanej (obieralny)"

## Efekty przedmiotowe

### Profil ogólnoakademicki - wiedza

**Efekt W\_01:**

Zna definicję zmiennej losowej oraz procesu stochastycznego wynikającą z aksjomatycznej teorii rachunku prawdopodobieństwa, zna pojęcia rozkładu skończenie wymiarowego procesu, wartości oczekiwanej, wariancji i kowariancji

Weryfikacja:

1 zadanie na kolokwium, wymagane jest uzyskanie ponad 50% punktów

**Powiązane efekty kierunkowe:** Tr2A\_W01

**Powiązane efekty obszarowe:** T2A\_W01

**Efekt W\_02:**

Ma wiedzę dotyczącą klasyfikacji procesów stochastycznych, zna definicje i własności procesu Poissona i Wienera

Weryfikacja:

1 zadanie na kolokwium, wymagane jest uzyskanie ponad 50% punktów

**Powiązane efekty kierunkowe:** Tr2A\_W01

**Powiązane efekty obszarowe:** T2A\_W01

**Efekt W\_03:**

Zna definicję procesu Markowa, rozumie pojęcie funkcji prawdopodobieństwa przejścia, zna zastosowania procesu Markowa w różnych dziedzinach wiedzy, zna ważne przykłady takie jak : błądzenie przypadkowe oraz proces dyfuzji

Weryfikacja:

1 zadanie na kolokwium, wymagane jest uzyskanie ponad 50% punktów

**Powiązane efekty kierunkowe:** Tr2A\_W01

**Powiązane efekty obszarowe:** T2A\_W01

### Profil ogólnoakademicki - umiejętności

**Efekt U\_01:**

Umie wyznaczać podstawowe parametry liczbowe procesu stochastycznego i na tej podstawie wyciągać wnioski co do jego własności

Weryfikacja:

1 zadanie na kolokwium, wymagane jest uzyskanie ponad 50% punktów

**Powiązane efekty kierunkowe:** Tr2A\_U08, Tr2A\_U04

**Powiązane efekty obszarowe:** T2A\_U09, T2A\_U05

**Efekt U\_02:**

Potrafi zastosować zdobytą wiedzę do modelowania problemów inżynierskich w podstawowym zakresie

Weryfikacja:

1 zadanie na kolokwium, wymagane jest uzyskanie ponad 50% punktów

**Powiązane efekty kierunkowe:** Tr2A\_U08, Tr2A\_U04

**Powiązane efekty obszarowe:** T2A\_U09, T2A\_U05