

EEE945 – Introdução aos Processos Estocásticos

2º Semestre de 2011

terças e quintas 13:00-14:40

Planejamento:

	Data	Assunto:	Atividade
1	13 - 10	Introdução a cadeias e processos de Markov. Representação gráfica.	
2	18 - 10	Matriz de transição. Probabilidades Estacionárias.	Lista1
3	20 - 10	Irreducibilidade. Ergodicidade.	
4	25 - 10	Periodicidade. Recorrência e Transiência.	Lista2
5	27 - 10	Processos de Markov em espaço finito.	
6	01 - 11	Simulação	Lista3
7	03 - 11	Cadeias de Markov em espaços contáveis.	
8	08 - 11	Crítério de Foster-Lyapunov.	Lista4
9	10 - 11	Hidden Markov Models e estimação.	
10	17 - 11	Continuação de Hidden Markov Models. Equações diferenciais estocásticas.	Lista5
11	22 - 11	Simulação. Equação de Fokker-Planck.	
12	24 - 11	Prova/Trabalho	