

Stokastiset prosessit, kevät 2009

Stokastiset prosessit, kevät 2009

Luennoitsija

[prof. Esa Nummelin](#)

Laajuus

6 op.

Tyyppi

Syventävä opinto.

Esitietovaatimukset

Johdatus todennäköisyyslaskentaan tai vastaavat tiedot.

Sisältö

Markovin ketjut, Poissonin prosessi, haarautumisprosessit, jatkuva-aikaiset Markovin prosessit, martingaalit. Materiaali: Luvut 1-8 verkossa "Stokastiset prosessit, kesä 2008". Luku 9 (martingaalit): Kirjasta Karlin&Taylor: A First Course in Stochastic Processes, luku 6 (kopio kansiossa huoneessa C326).

Tenttivaatimukset

Luvut 1-8. Siis luku 9 (Martingaalit) jää koealueen ulkopuolelle.

Suoritustapa

2. kurssikoetta tai loppukoe. 2. kurssikoe to 7.5. klo 16-18 salissa D123. Loppukoe yleistentissä 12.5. tai kesällä kesätentissä 11.6. Jos on osallistunut 1. kurssikokeeseen mutta on estynyt tulemaan 7.5. 2. kurssikokeeseen, 2. kurssikokeen voi suorittaa 12.5. yleistentin yhteydessä (tähän ilmoittautuminen suoraan luennoitsijalle). 2. kurssikokeen pistemäärää voi tiedustella tekstiviestitse (0505115075) tai sähköpostitse.