

MAE0499 – PROCESSOS ESTOCÁSTICOS

1º semestre 2019 (FEA-atuaria)

Prof. Anatoli Iambartsev

e-mail: yambar@ime.usp.br

página: <http://www.ime.usp.br/~yambar>

Cronograma de aulas:

Data	Assunto da aula	Data	Assunto da aula
02.09	Introdução	04.09	Semana da Pátria
09.09	T- Distribuição Condicional I	11.09	P- Distribuição Condicional I
16.09	T- Distribuição Condicional II	18.09	P- Distribuição Condicional II
23.09	T- Distribuição Condicional III	25.09	P- Distribuição Condicional III
30.09	Resumo	02.10	P1
07.10	T-Processo Poisson I	09.10	P-Processo Poisson I
14.10	T-Processo Poisson II	16.10	P-Processo Poisson II
21.10	T-Processo Poisson III	23.10	P-Processo Poisson III
28.10	Resumo (Funcionário Publico)	30.10	P2
04.11	T- Cadeias de Markov (tempo discreto) I	06.11	P- Cadeias de Markov (tempo discreto) I
11.11	T- Cadeias de Markov (tempo discreto) II	13.11	P- Cadeias de Markov (tempo discreto) II
18.11	T- Cadeias de Markov (tempo contínuo) I	20.11	P- Cadeias de Markov (tempo contínuo) I
25.11	T- Cadeias de Markov (tempo contínuo) II	27.11	P- Cadeias de Markov (tempo contínuo) II
02.12	Resumo	04.12	P3
09.12	Resumo	11.12	Prova Sub
16.12	Resumo	18.12	Prova Rec

Bibliografia

S.Ross. Introduction to Probability Models.

Critério de Avaliação

(a) Será aprovado o aluno que obtiver média final maior ou igual a 5 ($MF \geq 5$) e frequência $\geq 70\%$, onde

$$\text{sendo } MF = 0,80 MP + 0,20 ME$$

MP: média aritmética de provas 1, 2 e 3 (depois da sub),

ME: média de exercícios em casa;

(b) O aluno que ficar em recuperação deverá fazer avaliação se tem frequência $\geq 70\%$ e $3 \leq MF < 5$, em data a ser divulgada.

Conteúdo das provas

1ª prova (P1): Distribuição Condicional I, II, III.

2ª prova (P2): Processo de Poisson I, II, III.

3ª prova (P3): Cadeias de Markov com tempo discreto e contínuo.

4ª prova (P4): permitida somente ao aluno que tenha feito pelo menos duas provas.

Plantão de monitoria

a ser divulgado

Informações Gerais:

- 1) O conteúdo das aulas será disponibilizado na página da internet <http://www.ime.usp.br/~yambar>.
- 2) Toda aula terá uma lista de exercícios, que deverá ser entregue na aula seguinte (exceto informação em contrário, dada em aula).
- 3) Nos dias de prova trazer documento com foto, lápis, caneta, borracha e calculadora. Não será permitido o uso de aparelhos celulares e palm-tops.