

RECOMENDAÇÃO: Introdução à Probabilidade e à Estatística

OBJETIVOS:

EMENTA: Cadeias de Markov. Processos de ramificação. Passeios aleatórios. Processo de Poisson. Cadeias de Markov em tempo contínuo. Fila M/M/1. Teoria da Renovação. Movimento Browniano.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA:

DURRETT, R. Essentials of Stochastic Processes. New York: Springer-Verlag, 2012.

HAIGH, J. Probability Models. London: Springer, 2005.

ROSS, S. M. Introduction to Probability Models. 9th ed. Boston: Academic Press, 2006.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR:

BHAT, N.; MILLER, G. K.; Elements of Applied Stochastic Processes. New York: Wiley, 2002.

CINLAR, E.; Introduction to Stochastic Processes. Englewood Cliffs: Prentice-Hall, 1975.

GRIMMETT R.; STIRZAKER, D. R.; Probability and Random Processes. 2nd ed. Oxford: Oxford Science Publications, 1998.

KARLIN, S.; TAYLOR, H. M.; An Introduction to Stochastic Modeling. 3rd ed. San Diego: Academic Press, 1998.

RESNICK, S. I.; Adventures in Stochastic Processes. 1st ed. Boston: Birkhäuser, 1992.