

فرآیندهای تصادفی ۱

نیمسال دوم ۹۹-۹۸

<p>ارزشیابی شامل ۳ آزمون و تکلیف و پروژه ۱۵ درصد</p>	<p>۱- آشنایی دانشجویان با مفهوم فرآیندهای تصادفی از دیدگاه نظری و کاربردی ۲- شناسایی و تشخیص انواع فرآیندهای تصادفی مولفه ها و ویژگیهای آنها ۳- برآورد پارامترها و شبیه سازی فرآیندهای ساده و پر کاربرد مانند زنجیرهای مارکوف</p>	<p>هدف</p>
	<p>موضوع</p>	<p>ردیف</p>
<p>سه شنبه ۱۹ فروردین ۹۹ ۲۰ درصد</p>	<p>۱- تبدیل Z و برخی کاربردها ۲- فرآیندهای تصادفی: تعریف؛ ویژگیها؛ برخی فرآیندهای تصادفی ساده: مانند برنولی-دوجمله ای و اولین زمانهای رخداد ۲- فرآیند گام برداری تصادفی ساده؛</p>	<p>۱</p>
<p>سه شنبه ۲۳ اردیبهشت ۹۹ ۲۰ درصد</p>	<p>فرآیند پواسون: ویژگیهای فرآیند پواسون؛ فرآیند پواسون و توزیع یکنواخت؛ فرآیند پواسون و توزیع هندسی؛ فرآیند پواسون خوشه ای فرآیند پواسون ناهمگن</p>	<p>۲</p>
<p>۴۵ درصد</p>	<p>زنجیرهای مارکوف: طبقه بندی وضعیتها؛ وضعیتهای جاذب و زمانهای اولین گذر؛ قضایای حدی اساسی زنجیرهای مارکوف؛ روشهای محاسبه ماتریس احتمال تغییر وضعیت رفتار حدی زنجیرهای مارکوف؛ روش نظریه گراف استنباط آماری زنجیرهای مارکوف</p>	<p>۳</p>
	<p>۱- محمد امینی و ابوالقاسم بزرگ نیا (۱۳۸۶) مقدمه ای بر فرآیندهای تصادفی. گسترش علوم. 2-Peter W.J. and Peter S. (2010). Stochastic Processes: An Introduction. CRC Press. Second Edition. ترجمه شده توسط: محمد امینی و ابوالقاسم بزرگ نیا</p>	<p>منابع</p>