

Cp3 - Argomenti scelti di probabilità

Programma

Martingale: definizioni, tempi di arresto, supermartingale arrestate, teorema di Doob, esempio del semplice random walk. Teorema di convergenza di Doob. Martingale limitate in L^2 . Martingale uniformemente integrabili. Applicazioni.

Catene di Markov: proprietà di Markov, probabilità di transizione. Teoria di Doeblin. Teoria ergodica per le catene di Markov. Classificazione degli stati. Catene di Markov reversibili. Applicazioni

Materiale Didattico