

НАВЧАЛЬНИЙ ПЛАН КУРСУ
«ТЕОРІЯ ВИПАДКОВИХ ПРОЦЕСІВ»

I семестр

1. Характеристики випадкових процесів
2. Умовне математичне сподівання
3. Розподіли випадкових процесів
4. Процес Пуассона
5. Процес Вінера
6. Стаціонарні процеси
7. Процеси відновлення
8. Перетворення Лапласа

II семестр

1. Диференціювання випадкових процесів
2. Інтегрування випадкових процесів
3. Мартингали
4. Марковські процеси
5. Ланцюги Маркова
6. Рівняння Колмогорова
7. Нескінченно-подільні розподіли
8. Стохастичний інтеграл Іто
9. Гіллясті процеси