



UFBA

UNIVERSIDADE FEDERAL DA BAHIA
ESCOLA POLITÉCNICA
PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ENGENHARIAS ELÉTRICA E DE COMPUTAÇÃO



PPGEEC

PPGEE0015 - PROCESSOS ESTOCÁSTICOS

OBRIGATORIA: Não

CARGA HORÁRIA: 60 horas

NÚMERO DE CRÉDITOS: 4

EMENTA:

Introdução à probabilidade; variáveis aleatórias; funções de variáveis aleatórias; momentos; vetor de variáveis aleatórias; teoria da estimação; sequências aleatórias; processos estocásticos; processos estacionários.

BIBLIOGRAFIA:

- [1] H. Stark and J. W. Woods, "Probability, Random Processes, and Estimation Theory for Engineers", PrenticeHall, 2nd ed., 1994.
- [2] A. Papoulis, "Probability, Random Variables, and Stochastic Processes", McGraw-Hill, 1965.
- [3] W. Feller, "An Introduction to Probability Theory and Its Applications", John Wiley, 1968.
- [4] W. F. Davenport, "Probability and Random Processes: An Introduction for Applied Scientists and Engineers", McGrawHill, 1970.
- [5] A. B. Clarke and R. L. Disney, "Probability and Random Process: A first course with applications", John Wiley, 1985.
- [6] G. Grimmett and D. Stirzaker, "Probability and Random Processes". Oxford University Press, 4nd ed., 2020.