

Procesos Estocásticos II.
Procesos de Markov
Tarea-Examen

1.- De las notas, obtener las ecuaciones de Kolmogorov (atrasada o la adelantada) para el ejemplo 3.13 y probar por medio de ellas que las probabilidades de transición se distribuyen como una binomial negativa.

2.- Consideren un proceso de nacimiento y muerte con tasa de nacimiento $\{a_n\}$ y tasa de muerte $\{b_n\}$. Empezando en el estado i , encuentre la probabilidad de que los primeros k eventos sean todos nacimientos.

Se anexan los ejercicios que corresponden al libro de Sheldon Ross, “Stochastic Process”, deben hacer los problemas: 5.1, 5.2, 5.3, 5.4, 5.5, 5.7 y 5.10