

**UNIVERSIDADE FEDERAL DA BAHIA**
SISTEMA INTEGRADO DE GESTÃO DE ATIVIDADES
ACADÊMICAS

EMITIDO EM 28/05/2025 16:00

RESUMO DO COMPONENTE CURRICULAR**Dados Gerais do Componente Curricular**

Tipo do Componente Curricular:	DISCIPLINA
Unidade Responsável:	PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM MATEMÁTICA (PGMAT) (12.01.17.15)
Código:	PGMAT0068
Nome:	PROCESSOS ESTOCASTICOS
Carga Horária Teórica:	30 h.
Carga Horária Prática:	30 h.
Carga Horária Total:	60 h.
Excluir da Avaliação Institucional:	Não
Matriculável On-Line:	Sim
Horário Flexível da Turma:	Sim
Horário Flexível do Docente:	Sim
Obrigatoriedade de Conceito:	Sim
Pode Criar Turma Sem Solicitação:	Sim
Necessita de Orientador:	Não
Exige Horário:	Sim
Permite CH Compartilhada:	Não
Permite Múltiplas Aprovações:	Não
Quantidade de Avaliações:	1
Módulo:	
Ementa/Descrição:	Martingales a tempo discreto. Rigidez e convergência fraca em $D(0,1)$. Martingales a tempo contínuo. Processos Markovianos: construção, Teorema de Hille-Yosida, propriedades básicas, processos de Feller. Integração estocástica e difusões. Processos Estacionários.

Referências:**HISTÓRICO DE EQUIVALÊNCIAS**

Expressão de Equivalência	Ativa	Início da Vigência	Fim da Vigência
(MAT563/20012) OU (MAT563/20041) OU (MAT563/20151)	ATIVO	24/11/2022	