



Procesos
Estocásticos
Grado en Matemáticas
Aplicadas



UNIVERSIDAD
NEBRIJA

GUÍA DOCENTE

Asignatura: Procesos Estocásticos

Titulación: Grado en Matemáticas Aplicadas

Carácter: Obligatoria

Idioma: Castellano

Modalidad: Presencial

Créditos: 6

Curso: 3º

Semestre: 2º

Profesores/Equipo docente: D. Crisanto de los Santos Durán

1. COMPETENCIAS Y RESULTADOS DE APRENDIZAJE

1.1. Competencias

Competencias básicas

- CB1, CB2, CB3, CB4, CB5.

Competencias generales

- CG1. (Conocer) Demostrar poseer y comprender, a partir de la base de la educación secundaria, la naturaleza, conceptos, métodos y resultados más relevantes de los diferentes campos de las Matemáticas.
- CG2. (Aplicar) Saber aplicar los conocimientos adquiridos en la definición y planteamiento de problemas y en la búsqueda de sus soluciones en contextos matemáticos y no matemáticos.
- CG5. (Aprender) Haber desarrollado aquellas habilidades de aprendizaje necesarias para emprender, con un alto grado de autonomía, posteriores estudios especializados en el campo de las matemáticas o en cualquier otra disciplina que requiera conocimientos de matemáticas.

Competencias transversales

- CT1. (Comunicar) Comunicar de forma oral o escrita información, ideas, problemas y soluciones a un público tanto especializado como no especializado.
- CT2. (Usar herramientas) Identificar y conocer las herramientas informáticas básicas que sirven como instrumento de apoyo al trabajo académico y profesional.

- CT4. (Razonar de forma crítica) Razonar de forma crítica, contando con la información disponible, comprobando o refutando razonadamente los argumentos de otras personas.
- CT5. (Trabajar en equipo) Saber trabajar en equipo contribuyendo de forma activa al resultado de problema o proyecto a resolver.
- CT6. (Autonomía) Aprender de manera autónoma nuevos conocimientos y técnicas para adaptarse a nuevas situaciones en el entorno de las Matemática Aplicadas u otros.

Competencias específicas:

- CE1. (Comprender) Comprender el lenguaje matemático para utilizarlo con soltura.
- CE2. (Asimilar) Relacionar la definición de nuevos objetos matemáticos con otros conocidos para asimilarlos y deducir sus propiedades.
- CE3. (Demostrar) Identificar las ideas esenciales de las demostraciones de algunos teoremas básicos sabiéndolas adaptar para obtener otros resultados.
- CE4. (Abstraer) Saber abstraer las propiedades estructurales, distinguiéndolas de aquellas puramente ocasionales, para formular hipótesis y saber confirmarlas o refutarlas.
- CE5. (Resolver) Adquirir las técnicas y herramientas matemáticas adecuadas para planificar la resolución de problemas de matemáticas.
- CE6. (Modelizar) Utilizar las herramientas matemáticas más adecuadas a los fines que se persigan para proponer, analizar, validar e interpretar modelos matemáticos sencillos.
- CE7. (Instrumentalizar) Utilizar aplicaciones informáticas adecuadas para experimentar en matemáticas, resolver problemas y manejar modelos matemáticos.
- CE8. (Programar) Desarrollar programas que resuelvan problemas o modelos matemáticos utilizando cada caso el entorno computacional adecuado.
- CE10. (Concluir) Saber extraer conclusiones a partir de los resultados del análisis matemático de situaciones y fenómenos reales para integrarlas en otros ámbitos.

1.2. Resultados de aprendizaje

El estudiante al finalizar esta materia deberá:

- Desarrollar la intuición sobre fenómenos aleatorios y su tratamiento.
- Comprender y manejar los principios básicos del Cálculo de Probabilidades.
- Resolver de problemas de naturaleza probabilística.
- Conocer las propiedades básicas de los estimadores y manejar los métodos usuales para su construcción (máximo verosímil, de Bayes, mínimos cuadrados,...) incluyendo la estimación por intervalos.

- Plantear y resolver problemas de contraste de hipótesis en una y varias poblaciones
- Construir y analizar modelos lineales.
- Conocer fundamentos teóricos y prácticos de procesos estocásticos.
- Saber modelar casos reales en función de los modelos estudiados.
- Resolver de problemas de naturaleza estocástica.
- Comprender las limitaciones de los métodos utilizados y las condiciones bajo las cuales pueden ofrecer respuestas inapropiadas.
- Utilizar medios informáticos de análisis estadístico para resolver problemas y modelos.

2. CONTENIDOS

2.1. Requisitos previos

Haber cursado Estadística.

2.2. Descripción de los contenidos

Introducción a los Procesos Estocásticos. Cadenas de Markov Discretas. Teoría de Renovación y Proceso de Poisson. Cadenas de Markov a Tiempo Continuo. Procesos de Markov a tiempo continuo.

2.3. Contenido detallado

Presentación de la asignatura

Explicación de la **guía docente**

- **Introducción a los Procesos Estocásticos**
 - Definición y ejemplos básicos.
 - Conceptos preliminares.
 - Clasificación de procesos estocásticos.
- **Procesos de Bernoulli y de Poisson**
 - Proceso de Bernoulli.
 - Proceso de Poisson.
 - Procesos de conteo y ejemplos de aplicación.

- **Introducción a las Cadenas de Markov en Tiempo Discreto (DTMC)**

- Definición. Cadena de Markov homogénea.
- Camino aleatorio simple.
- Distribución inicial, matriz de transición.
- Diagramas de transición.
- Transición de n pasos.
- Ecuaciones de Chapman-Kolmogorov.
- Función de probabilidad de una DTMC homogénea.
- Tiempo de ocupación y matriz de tiempo de ocupación.

- **DTMC homogéneas. Comportamiento límite.**

- Tiempo de primera pasada.
- Accesibilidad y comunicación. Clases comunicantes. Irreducibilidad.
- Periodicidad. Estados recurrentes y transitorios. Clases recurrentes.
- Distribución estacionaria. Procesos de nacimiento y muerte.

- **Cadenas de Markov a tiempo continuo.**

- Probabilidades de transición.
- El generador infinitesimal.
- Ecuaciones de Kolmogorov.
- Procesos de nacimiento y muerte.
- Propiedades y aplicaciones.

2.4. Actividades dirigidas

Durante el curso se realizarán varias actividades dirigidas en forma de trabajos orientados al aprendizaje y aplicación de los nuevos conceptos aprendidos o ampliación de éstos. La actividad formativa “Prácticas” será el marco para establecer contenido y desarrollo de estas actividades que los estudiantes completarán de forma individual o en grupo. Así mismo se trabajará con diferentes paquetes de software especializado. La entrega y la asistencia a las actividades y/o prácticas es obligatoria. La falta de asistencia a una práctica conlleva automáticamente el suspenso de la asignatura en caso de que la ausencia no esté debidamente justificada.

2.5 Actividades formativas

CÓDIGO	ACTIVIDAD FORMATIVA	HORAS	PORCENTAJE DE PRESENCIALIDAD
AF1	Clases de teoría y problemas	45	100%
AF2	Tutorías	15	100%
AF3	Prácticas	9	100%
AF4	Estudio individual y trabajo autónomo	67	0%
AF5	Trabajos individuales o en grupo	11	0%
AF6	Evaluación	6	100%

3. SISTEMA DE EVALUACIÓN

3.1. Sistema de calificaciones

El sistema de calificaciones (R.D. 1125/2003, de 5 de septiembre) será el siguiente:

- 0 - 4,9 Suspenso (SS)
- 5,0 - 6,9 (Aprobado (AP)
- 7,0 - 8,9 Notable (NT)
- 9,0 - 10 Sobresaliente (SB)

La mención de «Matrícula de Honor» podrá ser otorgada a alumnos que hayan obtenido una calificación igual o superior a 9,0. Su número no podrá exceder del cinco por ciento de los alumnos matriculados en una materia en el correspondiente curso académico, salvo que el número de alumnos matriculados sea inferior a 20, en cuyo caso se podrá conceder una sola «Matrícula de Honor».

3.2. Criterios de evaluación

Convocatoria ordinaria

Sistemas de evaluación	Porcentaje
SE1 Prueba parcial	20%
SE2 Examen final	50%
SE3 Presentación de trabajos	30%

Convocatoria extraordinaria

Sistemas de evaluación	Porcentaje
SE2 Examen final	70%
SE3 Presentación de trabajos	30%

3.3. Restricciones

Calificación mínima

Las ponderaciones anteriores sólo se aplicarán si el alumno/a obtiene al menos un 4 en el examen final.

Es imprescindible la entrega de todos los trabajos y prácticas propuestas en la asignatura. Para poder hacer media de los trabajos/prácticas es necesario obtener en cada uno de ellos una nota igual o superior a 3.5 puntos, y la nota media de todos los trabajos/prácticas deber ser superior o igual a 5. La no superación de los trabajos/prácticas supone el suspenso automático de la asignatura.

La convocatoria extraordinaria consiste en un examen sobre los contenidos de la asignatura desarrollados en las clases de teoría y problemas. Este examen pondera un 70%, el resto de la nota final corresponde a la calificación de las entregas de trabajos evaluables solicitados durante el periodo docente. Si estos trabajos están suspensos en la convocatoria ordinaria, pueden ser recuperados en convocatoria extraordinaria previa petición del estudiante al profesor. Esta petición se debe realizar por escrito en un plazo máximo de 10 días después de la publicación de la nota final de la convocatoria ordinaria. Esta ponderación también se aplica sólo en el caso de que el alumno obtenga al menos un 4 en este examen final.

Asistencia

El alumno que, injustificadamente, deje de asistir a más de un 25% de las clases presenciales podrá verse privado del derecho a examinarse en la convocatoria ordinaria.

Normas de escritura

Se prestará especial atención en los trabajos, prácticas y proyectos escritos, así como en los exámenes tanto a la presentación como al contenido, cuidando los aspectos gramaticales y ortográficos. El no cumplimiento de los mínimos aceptables puede ocasionar que se resten puntos en dicho trabajo.

3.4. Advertencia sobre plagio

La Universidad Antonio de Nebrija no tolerará en ningún caso el plagio o copia. Se considerará plagio la reproducción de párrafos a partir de textos de auditoría distinta a la del estudiante (Internet, libros, artículos, trabajos de compañeros...), cuando no se cite la fuente original de la que provienen. El uso de las citas no puede ser indiscriminado. El plagio es un delito.

En caso de detectarse este tipo de prácticas, se considerará Falta Grave y se podrá aplicar la sanción prevista en el Reglamento del Alumno.

4. BIBLIOGRAFÍA

Bibliografía básica

- Karlin, S. y Taylor, H. M. *A First Course in Stochastic Processes*. Academic Press
- Kulkarni, V.G. *Modeling and Analysis of Stochastic Systems*. Chapman and Hall.
- Ross, S. M. *Introduction to Probability Models*. Academic Press, última edición.
- Ross S. M., *Stochastic Processes*. Wiley.

Bibliografía para prácticas

- Lawler, G. *Introduction to Stochastic Processes*. Chapman & Hall.
- Norris, J. R. *Markov Chains*. Cambridge University Press.
- Resnick, S. *Adventures in Stochastic Processes*. Birkhäuser.

Bibliografía complementaria

- Cox, D. R., y Miller, H. D. *The Theory of Stochastic Processes*. Chapman & Hall.
- Durrett, R. *Essentials of Stochastic Processes*. Springer.
- Parzen, E. *Stochastic Processes*. SIAM.