

Procesy stochastyczne

Zadania numeryczne

Zasady:

- Celem zadań przede wszystkim jest motywacja do dalszych poszukiwań i badań w zakresie procesów stochastycznych.
- Ilość możliwych punktów do uzyskania za dane zadanie podana jest obok jego numerka.
- Na pełne rozwiązanie składa się opis metody, przeliczony przykład oraz replikowany, działający kod wykorzystany do stworzenia przykładu.
- Implementacja możliwa jest w jednym z języków: C, C++, Python, R, Julia.
- W przypadku wykorzystywania dodatkowych bibliotek wymagane jest podanie wykorzystanej wersji.
- Rozwiązania można nadsyłać do końca semestru.

Zadanie 1. *Opisz i na wybranym przykładzie pokaż metodę symulacji niejednorodnego procesu Poissona.*

Zadanie 2.

Zadanie 3.

Zadanie 4.

Zadanie 5.

References