

## Lista 2.1 .

### Procesos estocásticos.

1. Conjunto de ejercicios 6.1-6.9, 6.13-6.17, 6.25-6.29, 6.38-6.40, 6.41-6.45.
2. Considere el proceso de Poisson  $\{N(t)\}_{t \geq 0}$ . Demuestre que para cualquier  $s \geq 0$ , el proceso estocástico  $N'(\cdot) = \{N'(t), t \geq 0\}$  definido por

$$N'(t) = N(t + s) - N(s), \forall t \geq 0$$

es de Poisson con parámetro  $\lambda$ , y que  $N'(\cdot)$  es independiente de  $\{N(r), r \leq s\}$ .