

Processos estocásticos - Alguns problemas e implementações

Objetivo:

Compreender as propriedades associadas aos processos de Poisson não homogêneo e a abordagem de simulação de eventos discretos na elaboração e análise de modelos probabilísticos.

Leituras sugeridas:

- ROSS, S. M. *Simulation*. 5th. Ed. London, UK: Academic Press, 2013.

Estudo e desenvolvimento:

1. Leia e estude profundamente a Seção 5.5 - *Generating a Nonhomogeneous Poisson Process*, de ROSS (2013).
2. Leia e estude profundamente a Seção 7.1 - *Simulation via Discrete Events*, de ROSS (2013).
3. Leia e estude profundamente a Seção 7.2 - *A Single-Server Queueing System*, de ROSS (2013).
4. Leia e estude profundamente a Seção 7.3 - *A Queueing System with Two Servers in Series*, de ROSS (2013).
5. Leia e estude profundamente a Seção 7.4 - *A Queueing System with Two Parallel Servers*, de ROSS (2013).
6. Leia e estude profundamente a Seção 7.5 - *An Inventory Model*, de ROSS (2013).
7. Leia e estude profundamente a Seção 7.6 - *An Insurance Risk Model*, de ROSS (2013).
8. Leia e estude profundamente a Seção 7.7 - *A Repair Problem*, de ROSS (2013).
9. Leia e estude profundamente a Seção 7.8 - *Exercising a Stock Option*, de ROSS (2013).
10. Leia e estude a Seção 7.9 - *Verification of the Simulation Model* de ROSS (2013).
11. Pergunta de interesse:
Como diminuir a variabilidade das estimações e como avaliar os resultados obtidos por simulações?