

Processi di punto di Poisson e applicazioni

Prof. Francesco Caravenna¹

¹Università di Padova
Dipartimento di Matematica Pura ed Applicata
Email: francesco.caravenna@math.unipd.it

Periodo: 10 ore svolte in aula 2AB/40, il 15 giugno 2009 ore 15.00-17.00 e 16, 17, 18 e 19 giugno 2009 ore 10.30-12.30.

Prerequisiti: È richiesta una buona conoscenza della probabilità di base (qualche nozione di teoria della misura è utile ma non necessaria). Non è necessario aver seguito il corso di Analisi Stocastica.

Tipologia di esame: Prova orale.

SSD: MAT/06

Programma del corso:

L'oggetto di questo corso è costituito dai processi di punto, che possono essere grossolanamente descritti come disposizioni aleatorie di punti nello spazio. Dopo aver introdotto questa classe di processi, si studieranno in un certo dettaglio le proprietà dei processi di punto di Poisson, che ne costituiscono l'esempio principale. Saranno infine discusse due importanti applicazioni, alla teoria dei vetri di spin (nell'ambito della meccanica statistica) e ai processi di Lévy.