

CP420 Probabilità 3

A.A. 2011/2012

Prof. Pietro Caputo

Catene di Markov e convergenza all'equilibrio

- 1. Passeggiate aleatorie e Catene di Markov** Successioni di variabili aleatorie. Passeggiate aleatorie. Catene di Markov a tempo discreto e tempo continuo. Misura invariante, time-reversal e reversibilità.
- 2. Esempi e modelli classici** Passeggiate aleatorie su grafi. Processi di nascita e morte. Processi di esclusione. Metodo Monte Carlo: algoritmi di tipo Metropolis e dinamiche di Glauber per il modello di Ising e altri sistemi interagenti.
- 3. Convergenza all'equilibrio I** Distanza in variazione, tempi di mixing. Teoremi ergodici. Tecniche di accoppiamento. Tempi stazionari forti. Applicazioni al problema del 'coupon collector' e al mescolamento di un mazzo di carte.
- 4. Convergenza all'equilibrio II** Convergenza in norma L^2 . Gap spettrale e stime dei tempi di rilassamento. Conduttanza e metodo dei cammini. Metodo della 'comparazione'. Convergenza all'equilibrio in termini di entropia e disuguaglianze di Sobolev logaritmiche. Esempi.
- 5. Altri argomenti scelti** Dinamica di Glauber per il modello di Curie-Weiss. Il fenomeno del 'cut-off'. Algoritmi per la 'simulazione perfetta'.

NB Per maggiori dettagli consultare il sito

www.mat.uniroma3.it/users/caputo/didattica/cp420/cp420_2011.html

TESTI CONSIGLIATI

- [1] D. LEVINE, Y. PERES, E. WILMER, *Markov chains and mixing times*. AMS Bookstore, (2009).

BIBLIOGRAFIA SUPPLEMENTARE

- [2] J.R. NORRIS, *Markov chains*. Cambridge University press, (2008).
[3] O. HÄGGSTRÖM, *Finite Markov chains and algorithmic applications*. Cambridge Univ. press, (2002).

MODALITÀ D'ESAME

- valutazione in itinere (“esoneri”)		<input type="checkbox"/> SI	<input checked="" type="checkbox"/> NO
- esame finale	scritto	<input type="checkbox"/> SI	<input checked="" type="checkbox"/> NO
	orale	<input checked="" type="checkbox"/> SI	<input type="checkbox"/> NO
- altre prove di valutazione del profitto (meglio descritte sotto)		<input type="checkbox"/> SI	<input checked="" type="checkbox"/> NO