



Kursplan för läsåret 2008/2009
(Genererad 2008-07-17.)

STATIONÄRA STOKASTISKA PROCESSER, PROJEKTDEL

FMS047

Stationary Stochastic Processes, Project Work

Antal högskolepoäng: 3. **Betygskala:** UG. **Nivå:** A (Avancerad nivå).

Undervisningspråk: Kursen ges på svenska. **Alternativobligatorisk för:** Pi2. **Valfri för:** D3, F3, I3. **Kursansvarig:** Lektor Maria Sandsten, sandsten@maths.lth.se, Matematisk statistik. **Förkunskapskrav:** Påbörjad FMS045 Stationära stokastiska processer.

Prestationsbedömning: Skriftlig och muntlig redovisning av projekt. **Övrigt:** Detta är en utökning av kursen Stationära stokastiska processer med ett projekt. **Hemsida:** <http://www.maths.lth.se/matstat/kurser/fms045mas210/index047.html>.

Syfte

Förstärka förståelsen av något eller några moment i kursen FMS045: Stationära stokastiska processer samt vidarutveckla förmågan att kommunicera resultat och resonemang.

Mål

Kunskap och förståelse

För godkänd kurs skall studenten

- modellera mätdata från naturen som en enkel stationär process,
- använda begreppen väntevärde, varians, kovarians, korskovarians, spektrum, korrspektrum, filtrering, derivata och sampling i samband med en stationär process.

Färdighet och förmåga

För godkänd kurs skall studenten

- analysera ett problem med hjälp av stationära processer och föreslå modell och lösning,
- använda Matlab som verktyg för beräkning och skattning av väntevärde, varians, kovarians och spektrum,
- dra slutsatser av resultat från beräkningar och simuleringar,
- redovisa problemställning, beräkningar, lösningar i skriftlig och muntlig form.

Innehåll

Praktisk färdighet i att identifiera och analysera stationära stokastiska processer.

Tillämpningarna hämtas främst från signal- och bildbehandling, reglerteknik, ekonomi och tillförlitlighetsteknik.

Litteratur

Se FMS045. För varje specifikt projekt kan kompletterande litteratur anvisas.