

MOS 60 J 25

Povzetek

V prvem razdelku so uvedeni pojmi: splošni slučajni proces (z diskretnim in zveznim parametrom), realizacija, bistvena zaloga vrednosti itd. V drugem razdelku sledi definicija markovske verige z zveznim parametrom (časom), njene osnovne lastnosti, pojem prehodne matrike in prehodne funkcije. Najobširnejši tretji razdelek je posvečen lastnostim prehodnih funkcij (merljivost, standardnost, eksistenca limit v točki nič), povezanost in razčlenitev prostora stanj na razrede med seboj povezanih stanj sledi v četrtem razdelku. Tu skuša po analogiji z verigami z diskretnim parametrom uvesti pojem povezanosti, pri čemer se opira tudi na tako imenovana diskretna ogrodja. Peti razdelek spregovori na kratko o limitah prehodnih funkcij v neskončnosti, šesti nekaj o odvedljivosti v točki nič. Sedmi razdelek uvede pojem standardnih modifikacij, separabilnosti in merljivosti pri splošnih slučajnih procesih in se zaradi prezahtevne teorije omeji na najenostavnejše. Nekaj splošnih zaključkov porabi pri markovskih verigah. Zadnji razdelek podaja princip, kako se da iz danih markovskih verig tvoriti nove.

Seznam uporabljene literature

- (1). Čžun Kaj-Laj: Odnorodnye cepi Markova
- (2). G.M.Fihtengol'c: Kurs diferencial'nogo i integral'nogo
isčislenija
- (3). J.L.Doob: Stochastic Processes
- (4). M.Fisz: Wahrscheinlichkeitstheorie und mathematische
Statistik
- (5). E.C.Titchmarsh: The Theory of Functions
- (6). W.Rudin: Real and Complex Analysis