

SPOJITE' MARTINGALY A ČÍŤACÍ' PROCESY

21.2.

- cíle:
 - techniky pro analýzu dat o přezítí'
 - doplnění' partii' ke stoch. analýze
- obsah:
 - I Procesy se spoj. časem
 - II Integrované' úči' martingalim s kon. variací'
 - III Limitní' věty pro martingaly
 - IV Úvod do cenobraní'

Procesy se spoj. časem

- (Ω, \mathcal{A}, P) jistí' prostor, $X_t: \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ náh. vel., $t \in [0, T]$, T (obvykle) kon. pevná' množina' \Rightarrow

$X = \{X_t, t \in [0, T]\}$ je proces se spoj. časem
(t interpretujeme jako čas)

- využití: teorie obsluhy...

- $X_t(\omega) \in \mathbb{R}$... stav procesu v čase t

$X_t(\cdot)$... náh. veličina, míř. zobr. z (Ω, \mathcal{A}) do $(\mathbb{R}, \mathcal{B})$

$X_\cdot(\omega)$... trajektorie procesu X (realizace procesu)

$X_\cdot(\omega)$ je náhodná' řez z $[0, T]$ do \mathbb{R}

