

Markov folyamatok és martingálok (BMETE95MM07) tételsor

Simon Károly
2014 ősz

1. σ -algebrák, feltételes várható érték, konvergenciafajták.
2. Martingálok definíciója, megállított martingál, alkalmazások (ABRA-KADABRA, bolyongások, Wald azonosság).
3. Martingál konvergencia-tételek, L^2 martingálok, Doob dekompozíció.
4. Egyenletesen integrálható martingálok, Lévy „felfelé” és „lefelé” tétel, alkalmazások (Kolmogorov 0 – 1 tv., NSZET).
5. Doob egyenlőtlenségek, Iterált log. tétel.
6. Stacionárius folyamatok, ergodtételek, Markov láncok ergodicitása.
7. Martingál CHT, Markov CHT.