

Sztochasztikus folyamatok tételek

2021/2022

1. Kolmogorov konzisztencia- és egzisztenciatétele
2. Feltételes várható érték, reguláris feltételes eloszlás
3. Martingálok diszkrét időben I: tulajdonságok, martingálkonvergenciatétel, Doob-felbontás
4. Martingálok diszkrét időben II: Doob maximálegyenlőtlensége, opcionális megállítás
5. Folytonos idejű martingálok
6. Wiener-folyamat I: létezés, Kolmogorov folytonossági tétele, Gauss-folyamatok
7. Wiener-folyamat II: $C(0, \infty)$ tér, Donsker-tétel, Markov-tulajdonság, trajektóriák tulajdonságai
8. Markov-folyamatok általánosan, átmenetvalószínűségek, Chapman–Kolmogorov-egyenletek, infinitezimális generátor, Kolmogorov-egyenletek