

Egzamin z procesów stochastycznych. Teoria. 5 II 2014.

Imię i Nazwisko:

Pytanie 1. (5 punktów) Co to jest błądzenie losowe i jakie ma własności? Podaj przykład błądzenia losowego.

Pytanie 2. (5 punktów) Co to jest łańcuch Markowa (z czasem dyskretnym). Podaj przykład dyskretnego łańcucha Markowa, który nie jest błądzeniem losowym. Co to jest jednorodny łańcuch Markowa, jego macierz przejścia i rozkład stacjonarny?

Pytanie 3. (5 punktów) Co to jest proces gaussowski i proces Wienera. Jakie są inne charakterystyki procesu Wienera?

Egzamin z procesów stochastycznych. Teoria. 5 II 2014.

Imię i Nazwisko:

Pytanie 1. (5 punktów) Co to jest błądzenie losowe i jakie ma własności? Podaj przykład błądzenia losowego.

Pytanie 2. (5 punktów) Co to jest łańcuch Markowa (z czasem dyskretnym). Podaj przykład dyskretnego łańcucha Markowa, który nie jest błądzeniem losowym. Co to jest jednorodny łańcuch Markowa, jego macierz przejścia i rozkład stacjonarny?

Pytanie 3. (5 punktów) Co to jest proces gaussowski i proces Wienera. Jakie są inne charakterystyki procesu Wienera?

Egzamin z procesów stochastycznych. Teoria. 5 II 2014.

Imię i Nazwisko:

Pytanie 1. (5 punktów) Co to jest błądzenie losowe i jakie ma własności? Podaj przykład błądzenia losowego.

Pytanie 2. (5 punktów) Co to jest łańcuch Markowa (z czasem dyskretnym). Podaj przykład dyskretnego łańcucha Markowa, który nie jest błądzeniem losowym. Co to jest jednorodny łańcuch Markowa, jego macierz przejścia i rozkład stacjonarny?

Pytanie 3. (5 punktów) Co to jest proces gaussowski i proces Wienera. Jakie są inne charakterystyki procesu Wienera?

Egzamin z procesów stochastycznych. Teoria. 5 II 2014.

Imię i Nazwisko:

Pytanie 1. (5 punktów) Co to jest błądzenie losowe i jakie ma własności? Podaj przykład błądzenia losowego.

Pytanie 2. (5 punktów) Co to jest łańcuch Markowa (z czasem dyskretnym). Podaj przykład dyskretnego łańcucha Markowa, który nie jest błądzeniem losowym. Co to jest jednorodny łańcuch Markowa, jego macierz przejścia i rozkład stacjonarny?

Pytanie 3. (5 punktów) Co to jest proces gaussowski i proces Wienera. Jakie są inne charakterystyki procesu Wienera?