

O B S A H

Předmluva	3
I. <u>Teoretické základy</u>	5
1. Pojem stochastického procesu	5
2. Klasifikace stochastických procesů	8
3. Střední hodnota	10
4. Cvičení	11
II. <u>Markovovy řetězce</u>	12
5. Markovovy řetězce se spočetným počtem stavů	12
6. Homogenní Markovovy řetězce - klasifikace stavů	15
7. Finální pravděpodobnosti	18
8. Cvičení	23
III. <u>Markovovy procesy</u>	25
9. Markovovy procesy se spočetným počtem stavů	25
10. Příklady homogenních Markovových procesů	28
11. Asymptotické vlastnosti	32
12. Cvičení	35
IV. <u>Stacionární procesy</u>	37
13. Derivace a integrál stochastického procesu	37
14. Stacionární procesy	39
15. Spektrální rozklad stacionárních procesů	42
16. Ergodické stacionární procesy	45
17. Cvičení	48
V. <u>Gaussovy procesy</u>	49
18. Definice Gaussova procesu	49
19. Gaussovy stacionární procesy	51
20. Simulace Gaussova rozložení	55
21. Cvičení	56
Literatura	57