

Obsah

Předmluva	7
I. Modely s diskrétními stavy	
1. Poissonův proces	11
2. Statistická analýza Poissonova procesu	17
3. Elementární modely hromadné obsluhy	25
4. Markovovy procesy	33
5. Markovovy řetězce	45
6. Statistické úlohy v Markovových řetězcích	61
7. Semimarkovské procesy	75
II. Porovnání s deterministickými modely	
8. Deterministické modely růstu a existenčního boje	87
9. Atomistické modely	97
III. Modely se spojitými stavy	
10. Bílý šum	107
11. Stochastický integrál	112
12. Stochastický diferenciál	120
13. Lineární stochastické diferenciální rovnice	127
14. Difúzní procesy	138
IV. Dynamická optimalizace	
15. Bellmanův princip	161
16. Řízení lineárních soustav s kvadratickým kritériem	168
Literatura	178
Rejstřík	180