Эргодическое подмножество состояний

В эргодическом подмножестве нет источников и концевых состояний, и нет замкнутых подмножеств состояний.

Подмножество называется транзитивным, если можно как войти в это подмножество, так и выйти из него

Случайный процесс, протекающий в системе S с дискретными состояниями называется марковским, если для любого момента времени t0 вероятность каждого из состояний..

Не важно, как мы попали к это состояние, важно, какая вероятность перехода в след состояние

Называется свойство Маркова

Марковский процесс с дискретным временем

* Переход системы S между своими дискретными состояниями происходит только в определенные дискретные моменты времени
* Система может изменять свое состояние только по шагам
* Время между шагами не обязательно одинаковое, но в расчётах используются только номера шагов.

# Однородный марковский процесс

Переходные вероятности не изменяются со временем

Марковские процессы с непрерывным временем

Потоки событий

Предельные теоремы теории потоков