

# 目录

## 1 离散时间马氏链

### 1.1 马氏性及其等价形式

#### 1.1.1 简单马氏性

**Definition 1.**  $X = (X_n : n \geq 1)$  关于  $\sigma$ -代数流  $(\mathcal{G}_n : n \geq 1)$  是**适应的**, 即  $\forall n, X_n$  关于  $\mathcal{G}_n$  可测。令  $\mathcal{F}_n = \sigma(X_0, X_1, \dots, X_n)$ 。称  $(\mathcal{F}_n : n \geq 1)$  为  $(X_n : n \geq 1)$  的**自然  $\sigma$ -代数流**。