TIN 086 Vybrané kapitoly z výpočetní složitosti II **léto 2015/2016**

1. domácí úlohy - Markovovský proces

do 29. března 2016

Úloha 1. Mějme ireducibilní aperiodický Markovovský proces s maticí přechodu P. (Ireducibilní znamená, že všechny stavy spolu komunikují.) Ukažtě, že

a) pro každé i a j existuje M takové, že pro všechna $t \geq M$, $p_{i,j}^{(t)} > 0$. Jak velké M je potřeba?

b) existuje M takové že pro všechna $t > M$, $\min_{i,j} p_{i,j}^{(t)} > 0$.

c) existuje M takové, že $\inf_{t \geq M} \min_{i,j} p_{i,j}^{(t)} > 0$.

(První dvě tvrzení by měla být dokázána bez použití vět o Markovovských procesech. Můžete použít Čínskou větu o zbytcích.)

Úloha 2. Uvažujme Markovovský proces $X_0, X_1, X_2, \ldots$ se stavy $\{1, 2, 3\}$ a maticí přechodu P. Nalezněte funkci $f : \{1, 2, 3\} \to \{1, 2\}$ a matici P takovou, že $f(X_0), f(X_1), f(X_2), \ldots$ není Markovovský proces.

Úloha 3.

a) Ukažte příklad Markovovského procesu, který má více různých stacionárních distribucí.

b) S užitím faktu, že každý ergodický, tj. aperiodický a ireducibilní, Markovovský proces má právě jednu stacionární distribuci, ukažte, že každý ireducibilní Markovovský proces má taktéž právě jednu stacionární distribuci.

Úloha 4. Uvažujme pohyb krále po šachovnici: v každém kroku náhodně uniformě vybereme jeden z jeho možných tahů a ten provedeme. Definujte příslušný Markovovský proces a nalezněte jeho stacionární distribuci.