

## Požadavky ke zkoušce z Markovských procesů, LS 2007/2008

### Věty s důkazy:

Věta 1.1 (Pravděpodobnost cylindrické množiny a podmíněná střední hodnota funkcionálu trajektorií pomocí přechodové funkce)

Tvrzení 2.4 (silná spojitost fellerovské semigrupy), princip důkazu

Tvrzení 2.6 (stochastická spojitost fellerovského procesu)

Věta Krylova-Bogoljubova o existenci invariantní míry

Věta o uniformní exponenciální ergodicitě

U všech ostatních probíraných tvrzení je třeba znát jejich znění v nějaké správné verzi a mít aspoň hrubou představu o tom, jak se dokazují (kromě případů, kde jsme se o tom na přednášce nezmiňovali). Hlavně je ale třeba mít představu, jak se aplikují na konkrétní procesy a především pak na stochastické diferenciální rovnice (dle míry znalosti teorie stochastických diferenciálních rovnic zkoušeného), včetně představy např. o příslušných l'apjunovských podmínkách. Předpokládá se, že zkoušený bude schopen rozumné konverzace těchto věcech.

### Termíny:

Na zkoušku se přihlásíte tak, že mi pošlete mail. Přihláška nabývá platnosti v okamžiku, kdy dostanete moji afirmativní odpověď! Může se stát, že pokud by některý termín byl už hodně zaplněn, požádám vás o změnu.

Termíny (jsou to všechno úterky):

27.května

3.června

10.června

17.června

Potom budu víceméně souvisle pryč (s malou přestávkou v první polovině srpna) až do 16. září. Individuální domluva je vždy možná.