

38. Co je to tzv. „průsek“ u Markovovského procesu

Markovův proces označuje stochastický řetězec, kde pravděpodobnosti, s nimiž nastávají jednotlivé změny – přechody mezi dvěma stavy – nejsou ovlivňovány předchozí historií procesu.

Pravděpodobnost přechodu systému ze stavu e_i do stavu e_j není nijak závislá na tom, jak se systém do stavu e_j dostal.

Průsekem stochastického procesu rozumíme stav procesu E v okamžiku t_0 nabývající hodnoty $X(t_0)$, kde $\{X(t_0), t_0 \in T\}$ a množina T značí množinu všech časových okamžiků.

Pravděpodobnost, že se systém nachází v okamžiku t_n ($n=0,1,2,\dots,n$) **právě** ve stavu X_i ($i=1,2,3,\dots,s$), označujeme jako $p_i(t)$. Vektor pravděpodobností $\mathbf{p}(t)=[p_1(t), p_2(t), p_i(t)]$, $t=0,1,2,\dots$ nazýváme *pravděpodobnostním vektorem stavu systému v okamžiku n* .

