

6. Stokastiset prosessit (2)

6. Stokastiset prosessit (2)

Sisältö

- Markov-prosessit
- Syntymä-kuolema-prosessit

6. Stokastiset prosessit (2)

Markov-prosessi

- Tark. jatkuva-aikaista ja diskreettitaista stokastista prosessia $X(t)$
 - joko tila-avaruudella $S = \{0, 1, \dots, N\}$ tai $S = \{0, 1, \dots\}$
- **Määr.** Prosessi $X(t)$ on **Markov-prosessi**, jos

$$P\{X(t_{n+1}) = x_{n+1} \mid X(t_1) = x_1, \dots, X(t_n) = x_n\} = \\ P\{X(t_{n+1}) = x_{n+1} \mid X(t_n) = x_n\}$$

kaikilla n , $t_1 < \dots < t_{n+1}$ ja x_1, \dots, x_{n+1}

- Tätä ehtoa sanotaan **Markov-ominaisuudeksi**
 - Jos Markov-prosessin nykytila tunnetaan, prosessin tulevaisuus ei mitenkään riipu prosessin aiemmasta menneisyydestä (eli siitä, miten nykytilaan on tultu)
 - Nykytila siis sisältää kaiken jatkon kannalta tarpeellisen informaation

6. Stokastiset prosessit (2)

Esimerkki

- Riippumattomien lisäysten prosessi $X(t)$ on aina Markov-prosessi:

$$X(t_n) = X(t_{n-1}) + (X(t_n) - X(t_{n-1}))$$

- **Seuraus:** Poisson-prosessi $A(t)$ on Markov-prosessi
 - Määritelmän 3 mukaan Poisson-prosessin lisäykset ovat riippumattomia

Aikahomogeenisuus

- **Määr.** Markov-prosessi $X(t)$ on **aikahomogeeninen**, jos

$$P\{X(t + \Delta) = y \mid X(t) = x\} = P\{X(\Delta) = y \mid X(0) = x\}$$

kaikilla $t, \Delta \geq 0$ ja $x, y \in S$

- Todennäköisyydet $P\{X(t + \Delta) = y \mid X(t) = x\}$ eivät siis riipu t :stä

5

Tilasiirtymäintensiteetit

- Tarkastellaan aikahomogeenista Markov-prosessia $X(t)$
- **Tilasiirtymäintensiteetit** q_{ij} (state transition rate), missä $i, j \in S$, määritellään seuraavasti:

$$q_{ij} := \lim_{h \downarrow 0} \frac{1}{h} P\{X(h) = j \mid X(0) = i\}$$

- Tilatodennäköisyydet $P\{X(t) = i\}$, $i \in S$, määräytyvät yksikäsitteisesti siirtymä-intensiteeteistä q_{ij} , kunhan ns. **alkujakauma** (initial distribution) eli todennäköisyydet $P\{X(0) = i\}$, $i \in S$, on annettu
- **Huom.** Jatkossa rajoitamme tarkastelumme pelkästään aikahomogeenisiin Markov-prosesseihin

6

Eksponentiaalisesti jakautuneet tilassaoloajat

- Oletetaan, että Markov-prosessi on tilassa i hetkellä t .
- Lyhyellä aikavälillä $(t, t+h]$ prosessi siirtyy uuteen tilaan j tn:llä $q_{ij}h + o(h)$ (riippumatta siitä, mitä tapahtui ennen hetkeä t)
- Merkitään q_i :llä kokonaisintensiteettiä siirtyä pois tilasta i , ts.

$$q_i := \sum_{j \neq i} q_{ij}$$

- Lyhyellä aikavälillä $(t, t+h]$ prosessi siirtyy pois tilasta i tn:llä $q_i h + o(h)$ (riippumatta siitä, mitä tapahtui ennen hetkeä t)
- Kyseessä on selvästikin ns. unohtavuusominaisuus
- Tilassa i vietetty aika noudattaa siis eksponenttijakaumaa intensiteettinään q_i

7

Tilasiirtymätodennäköisyydet

- Merkitään T_i :llä oloaikaa tilassa i ja T_{ij} :llä sellaista (potentiaalista) oloaikaa tilassa i , joka päättyy siirtymään tilaan j :

$$T_i \sim \text{Exp}(q_i), \quad T_{ij} \sim \text{Exp}(q_{ij})$$

- Sm T_i voidaan ajatella riippumattomien ja eksponentiaalisesti jakautuneiden sm:ien T_{ij} minimiksi (ks. luennon 5 kalvo 44):

$$T_i = \min_{j \neq i} T_{ij}$$

- Merk. p_{ij} :llä todennäköisyyttä, että toteutunut siirtymä on tilasta i tilaan j . Ko. **tilasiirtymätodennäköisyydet** (state transition probabilities) saadaan kaavalla

$$p_{ij} = P\{T_i = T_{ij}\} = \frac{q_{ij}}{q_i}$$

8

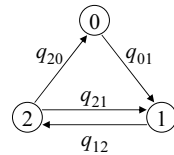
Tilasiirtymäkaavio

- Aikahomogeeninen Markov-prosessi esitetään usein ns. **tilasiirtymäkaavion** (state transition diagram) avulla. Kyseessä on suunnattu verkko, jonka
 - solmut vastaavat prosessin tiloja ja
 - yksisuuntaiset linkit vastaavat mahdollisia tilasiirtymiä

linkki tilasta i tilaan $j \Leftrightarrow q_{ij} > 0$

- Esim.** Kolmitilainen Markov-prosessi ($S = \{0,1,2\}$):

$$Q = \begin{pmatrix} - & + & 0 \\ 0 & - & + \\ + & + & - \end{pmatrix}$$



9

Pelkistymättömyys

- Määr.** Tilasta i pääsee tilaan j ($i \rightarrow j$), jos tilasiirtymäkaaviosta löytyy suunnattu polku i :stä j :hin
 - Jos näin on, niin lähettäessä tilasta i tilassa j käydään (joskus tulevaisuudessa) positiivisella todennäköisyydellä
- Määr.** Tilat i ja j **kommunikoivat** ($i \leftrightarrow j$), jos $i \rightarrow j$ ja $j \rightarrow i$
- Määr.** Markov-prosessi on **pelkistymätön** (irreducible), jos kaikki tilat kommunikoivat keskenään
 - Esimerkiksi edellisellä kalvolla esitetty Markov-prosessi on pelkistymätön

10

Tasapainojakauma ja globaalit tasapainoyhtälöt

- Tark. pelkistymätöntä Markov-prosessia $X(t)$ siirtymäintensiteetein q_{ij}
- Määr.** Olkoon $\pi = (\pi_i \mid \pi_i \geq 0, i \in S)$ tila-avaruudessa S määritelty jakauma, ts. se toteuttaa ns. **normeerausehdon**

$$\sum_{i \in S} \pi_i = 1 \quad (\text{N})$$

Jakauma π on prosessin $X(t)$ **tasapainojakauma** (equilibrium distribution), jos seuraavat **globaalit tasapainoehdot** (global balance equations) ovat voimassa kaikilla $i \in S$:

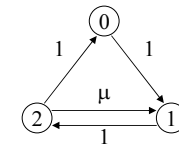
$$\sum_{j \neq i} \pi_j q_{ji} = \sum_{j \neq i} \pi_i q_{ij} \quad (\text{GBE})$$

- On mahdollista, ettei prosessilla ole tasapainojakaumaa. Kuitenkin, jos esim. tila-avaruus on äärellinen, tasapainojakauma on aina olemassa.
- Valitsemalla tasapainojakauma alkujakaumaksi (ts. $P\{X(0) = i\} = \pi_i$), ko. Markov-prosessista tulee stationaarinen (stationaarisena jakaumanaan π)

11

Esimerkki

$$Q = \begin{pmatrix} - & 1 & 0 \\ 0 & - & 1 \\ 1 & \mu & - \end{pmatrix}$$



$$\pi_0 + \pi_1 + \pi_2 = 1 \quad (\text{N})$$

$$\pi_0 \cdot 1 = \pi_2 \cdot 1$$

$$\pi_1 \cdot 1 = \pi_0 \cdot 1 + \pi_2 \cdot \mu \quad (\text{GBE})$$

$$\pi_2 \cdot (1 + \mu) = \pi_1 \cdot 1$$

$$\Rightarrow \pi_0 = \frac{1}{3+\mu}, \quad \pi_1 = \frac{1+\mu}{3+\mu}, \quad \pi_2 = \frac{1}{3+\mu}$$

12

Lokaalit tasapainoyhtälöt ja kääntyvyys

- Tarkastellaan edelleen pelkistymätöntä Markov-prosessia $X(t)$ siirtymä-intensiteetein q_{ij}
- Väite.** Olkoon $\pi = (\pi_i \mid \pi_i \geq 0, i \in S)$ tila-avaruudessa S määritelty jakauma, ts.

$$\sum_{i \in S} \pi_i = 1 \quad (\text{N})$$

Jos seuraavat **lokaalit tasapainoehdot** (local balance equations) ovat voimassa kaikilla $i, j \in S$:

$$\pi_i q_{ij} = \pi_j q_{ji} \quad (\text{LBE})$$

niin π on prosessin tasapainojakauma.

- Tod.** (GBE):t seuraavat (LBE):istä summaamalla $j \neq i$
- Tässä tapauksessa ko. Markov-prosessia sanotaan **kääntyväksi** (reversible)

13

Sisältö

- Markov-prosessit
- Syntymä-kuolema-prosessit

14

Syntymä-kuolema-prosessi

- Tark. jatkuva-aikaista ja diskreettitaista Markov-prosessia $X(t)$
 - joko tila-avaruudella $S = \{0, 1, \dots, N\}$ tai $S = \{0, 1, \dots\}$
- Määr.** Markov-prosessi $X(t)$ on **syntymä-kuolema-prosessi** (birth-death process), jos tilasiirtymät ovat mahdollisia vain vierekkäisten tilojen välillä, ts.

$$|i - j| > 1 \Rightarrow q_{ij} = 0$$

- Tässä tapauksessa merkitään

$$\mu_i := q_{i, i-1} \geq 0$$

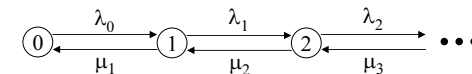
$$\lambda_i := q_{i, i+1} \geq 0$$

- Huom. $\mu_0 = 0$ ja $\lambda_N = 0$ (kun $N < \infty$)

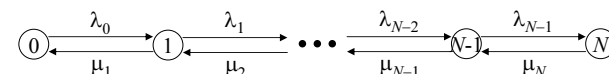
15

Pelkistymättömyys

- Väite:** Syntymä-kuolema-prosessi on pelkistymätön, jos ja vain jos $\lambda_i > 0$ kaikilla $i \in S \setminus \{N\}$ ja $\mu_i > 0$ kaikilla $i \in S \setminus \{0\}$
- Ääretöntilaisen pelkistymättömän sk-prosessin tilasiirtymäkaavio:



- Äärellistilaisen pelkistymättömän sk-prosessin tilasiirtymäkaavio:



16

Tasapainojakauma (1)

- Tarkastellaan pelkistymätöntä syntymä-kuolema-prosessia $X(t)$
- Tarkoitus on johtaa tasapainojakauma $\pi = (\pi_i \mid i \in S)$, mikäli sellainen on olemassa
- Lokaalit tasapainoyhtälöt:

$$\pi_i \lambda_i = \pi_{i+1} \mu_{i+1} \quad (\text{LBE})$$

- Näin ollen

$$\pi_{i+1} = \frac{\lambda_i}{\mu_{i+1}} \pi_i \Rightarrow \pi_i = \pi_0 \prod_{j=1}^i \frac{\lambda_{j-1}}{\mu_j}$$

- Jakaumaehto eli normerausehto:

$$\sum_{i \in S} \pi_i = \pi_0 \sum_{i \in S} \prod_{j=1}^i \frac{\lambda_{j-1}}{\mu_j} = 1 \quad (\text{N})$$

17

Tasapainojakauma (2)

- Tasapainojakauma on siis olemassa täsmälleen silloin, kun

$$\sum_{i \in S} \prod_{j=1}^i \frac{\lambda_{j-1}}{\mu_j} < \infty$$

- Äärellinen tila-avaruus:**

Ko. summa on aina äärellinen. Tasapainojakaumaksi tulee

$$\pi_i = \pi_0 \prod_{j=1}^i \frac{\lambda_{j-1}}{\mu_j}, \quad \pi_0 = \left(1 + \sum_{i=1}^N \prod_{j=1}^i \frac{\lambda_{j-1}}{\mu_j} \right)^{-1}$$

- Ääretön tila-avaruus:**

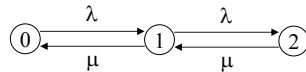
Jos ko. summa on äärellinen, niin tasapainojakaumaksi tulee

$$\pi_i = \pi_0 \prod_{j=1}^i \frac{\lambda_{j-1}}{\mu_j}, \quad \pi_0 = \left(1 + \sum_{i=1}^{\infty} \prod_{j=1}^i \frac{\lambda_{j-1}}{\mu_j} \right)^{-1}$$

18

Esimerkki

$$Q = \begin{pmatrix} - & \lambda & 0 \\ \mu & - & \lambda \\ 0 & \mu & - \end{pmatrix}$$



$$\pi_i \lambda = \pi_{i+1} \mu$$

$$\Rightarrow \pi_{i+1} = \rho \pi_i \quad (\rho := \lambda / \mu) \quad (\text{LBE})$$

$$\Rightarrow \pi_i = \pi_0 \rho^i$$

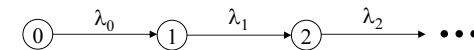
$$\pi_0 + \pi_1 + \pi_2 = \pi_0 (1 + \rho + \rho^2) = 1 \quad (\text{N})$$

$$\Rightarrow \pi_i = \frac{\rho^i}{1 + \rho + \rho^2}$$

19

Puhdas syntymäprosessi

- Määr.** Syntymä-kuolema-prosessi on **puhdas syntymäprosessi**, jos $\mu_i = 0$ kaikilla $i \in S$
- Ääretöntilaisen syntymäprosessin tilasiirtymäkaavio:



- Äärellistilaisen syntymäprosessin tilasiirtymäkaavio:



- Esimerkiksi Poisson-prosessi on ääretöntilainen puhdas syntymäprosessi (intensiteetti $\lambda_i = \lambda$ kaikilla $i \in S = \{0, 1, \dots\}$)
- Huom.** Puhdas syntymäprosessi ei ole koskaan pelkistymätön (saati sitten stationaarinen).

20