

**Plan för föreläsningarna i SF1831 (äldre kursnr: 5B1717)  
Optimeringslära och markovprocesser, del 1, för F3 under  
höstterminen 2008**

---

**Kurslitteratur**

(1) Jan Enger, Jan Grandell: Markovprocesser och köteori.

Föreläsning	Innehåll	Litteratur
1	Markovprocesser i diskret tid (Tillståndsgraf, Chapman-Kolmogorovs ekvationer, asymptotik)	Kapitel i (1): 3.1–3.2
2	Markovprocesser i diskret tid (forts.)  (Betingade väntevärden, klassificering av tillstånd, absorption, stationärfördelning, ergodicitet)	2, 3.3, 4, 5.1–5.4
3	Markovprocesser i kontinuerlig tid  (Chapman-Kolmogorovs ekvationer, intensitetsmatris, framåt- och bakåtekvationerna, stationaritet)	6.1–6.3, 6.6–6.7
4	Markovprocesser i kontinuerlig tid (forts.) (Ergodicitet, födelse-/döds-processer, Poisson-processen, köteori, $M/M/1$ )	6.4–6.5, 6.8
5	Köteori ( $M/M/c$ , Little's formler, könätverk)	7.1–7.3
6	Könätverk och generella modeller	7.7, 7.4