

11 вересня 2013 року о 14 год 10 хв

Исследуется сходимость последовательности марковских процессов такой, что вне произвольной окрестности фиксированной "сингулярной" точки их распределение притягивается к известному закону.

В окрестности этой точки поведение может быть нерегулярным. В качестве примера рассмотрена последовательность

$(X_n(t) = \frac{S(\lfloor nt \rfloor)}{\sqrt{n}}, n \geq 1)$, где $(S(n), n \geq 0)$ -- цепь Маркова на (\mathbb{Z}) , переходные вероятности которой удовлетворяют условиям:

$(p_{i, i \pm 1} = 1/2, |i| > m,)$ и $(\sum_j p_{ij} < 1)$