

Práce se zabývá filtrováním a predikcí procesů s diskrétním časem. Na začátek představíme základní značení a teorii markovských řetězců a náhodných procházek. Dále popíšeme přístup k filtračním metodám včetně doprovodných komentářů, obrázků a příkladů. Poté dokážeme jednu ze základních vět o filtračních rovnicích a grafickým i početním vyřešením dvou problémů vysvětlíme souvislosti těchto rovnic s úvodem kapitoly. Na závěr práce stručně popíšeme téma predikce a dokážeme větu, jež dále demonstrujeme na konkrétním problému.