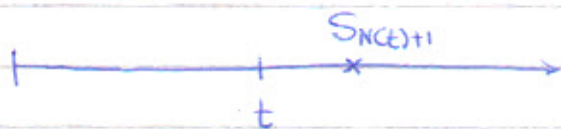


④ Παρ. 2 - Αναμενόμενη επίδοση για την $E[S_{N(t)+1}]$

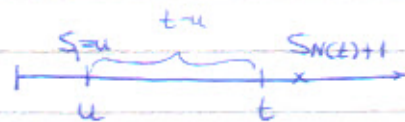
$$H(t) = E[S_{N(t)+1}]$$

ο αριθμός των θα συμβεί το πρώτο γεγονός μετά τη χρονική στιγμή t



$$H(t) = \int_0^{\infty} E[S_{N(t)+1} | S_1 = u] dG(u)$$

$$E[S_{N(t)+1} | S_1 = u] = \begin{cases} u & , u > t \\ u + \underbrace{E[S_{N(t-u)+1}]}_{H(t-u)} & , u \leq t \end{cases}$$



$$H(t) = \int_0^t u dG(u) + \int_0^t H(t-u) dG(u) \quad \text{αναμενόμενη επίδοση με } D(t) = \mu$$

∇ los ημάρδες: $u \leq t$ θα αναγερεται στο $H(t-u)$ / 2ος ημάρδες: $u > t$ στο $D(t)$

⑤ Λίον αναμενόμενης επίδοσης

Αναμ. επίδοσης: $H(t) = D(t) + \int_0^t H(t-u) dG(u) = D(t) + (H * G)(t)$

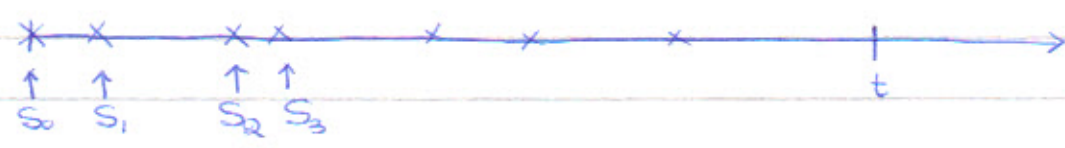
Λίον: $H(t) = D(t) + \int_0^t D(t-u) dM_G(u) = D(t) + (D * M_G)(t)$

Από: $H(t) = D(t) + (H * G)(t) \xrightarrow{L-S} \tilde{H}(s) = \tilde{D}(s) + \tilde{H}(s) \tilde{G}(s) \Rightarrow \tilde{H}(s) = \tilde{D}(s) \frac{1}{1 - \tilde{G}(s)}$

Quis $\tilde{M}_G(s) = \frac{\tilde{G}(s)}{1 - \tilde{G}(s)}$

Αρα, $\tilde{H}(s) = \tilde{D}(s) \left(1 + \frac{\tilde{G}(s)}{1 - \tilde{G}(s)} \right) = \tilde{D}(s) + \tilde{D}(s) \tilde{M}_G(s) \Rightarrow H(t) = D(t) + (D * M_G)(t)$

Ⓒ Εφαρμογή αναμετασχηματισμού Εξισώσεις - ζώνης



$H(t)$: αμεγλυμμένη ευθεία μετά από t αμοιόμορφα γεγονότα

$D(t)$: ευθεία μετά από t αμοιόμορφα 1 γεγονός

Αναμ. Εξίσωση: $H(t) = D(t) + \int_0^t H(t-u) dG(u)$

\nearrow αμεγλυμμένη ευθεία μέχρι t
 \nearrow ευθεία μετά από το γεγονός στο S_1
 \nearrow ευθεία μετά από τα γεγονότα S_1, S_2, \dots μέχρι t

Λύση: $H(t) = \sum_{n=0}^{\infty} \int_0^t D(t-u) dG_{S_n}(u) = \sum_{n=0}^{\infty} \int_0^t D(t-u) dG^{*n}(u) \Rightarrow$

$\Rightarrow H(t) = D(t) + \int_0^t D(t-u) dM_G(u)$, όπου $M_G(t) = \sum_{n=1}^{\infty} G^{*n}(t)$

Ⓕ Ορισμός ζώνης Αναμετασχηματισμού Εξισώσεις - Βασικό Αναμετασχηματιστικό Θεώρημα (BAΘ)

$H(t) = D(t) + \int_0^t H(t-u) dG(u)$

Λύση: $H(t) = D(t) + \int_0^t D(t-u) dM_G(u)$

$\lim_{t \rightarrow \infty} H(t) = ;$

BAΘ: Αν $\int_0^{\infty} |D(t)| dt < \infty$ και $\int_0^{\infty} |G(t)| dt < \infty$ τότε $\lim_{t \rightarrow \infty} H(t) = \frac{\int_0^{\infty} D(t) dt}{1 - \int_0^{\infty} G(t) dt}$

2] Π.θ. γαλαρίας aus μηχανής au εγγυη t = P(I(t)=1) ← Αναρ. Εξ + Αξον

3] Ορισμ υειθ γαλαρίας aus μηχανής = $\lim_{t \rightarrow \infty} P(I(t)=1)$ ← ΒΑΘ

1] Ορίζω διαδυνατια αμιαθris R(t) = $\int_0^t I(u) du$

Εξομre $(X_n, R_n) = (U_n + D_n, U_n)$ αυξή 100v (αφα και τα αργαυα (U_n, D_n) αυξή 100v)

ΣΑΘΑ είναι εφαρμόσιμo : $\lim_{t \rightarrow \infty} \frac{E[R_n]}{t} = \frac{E[R_1]}{E[X_1]} = \frac{E[U]}{E[U] + E[D]} = \frac{\mu_u}{\mu_u + \mu_d}$

2] $H(t) = P(I(t)=1) = \int_0^\infty P(I(t)=1 | X_1=u) dG_{u+D}(u)$

$P(I(t)=1 | X_1=u) = \begin{cases} P(U_1 > t | U_1 + D_1 = u) & u > t \\ P(I(t-u)=1) = H(t-u) & u \leq t \end{cases}$

Αρα, $H(t) = \int_t^\infty P(U_1 > t | U_1 + D_1 = u) dG_{u+D}(u) + \int_0^t H(t-u) dG(u)$

$D(t) = \int_t^\infty P(U_1 > t | U_1 + D_1 = u) dG(u) = \int_t^\infty P(U_1 > t | U_1 + D_1 = u) \underbrace{g_{U_1+D_1}(u)}_{\text{ππ aus } U_1+D_1} du$

! $f_{x|y}(x|y) = \frac{f_{x,y}(x,y)}{f_y(y)}$

$= \int_t^\infty P(U_1 > t, U_1 + D_1 = u) g_{U_1+D_1}(u) du = P(U_1 > t, U_1 + D_1 > t) =$

$= P(U_1 > t) = 1 - G_u(t)$

2 weeks...

Αρα, $H(t) = 1 - G_0(t) + (H * G)(t)$

Λίστα: $H(t) = 1 - G_0(t) + \int_0^t (1 - G_0)(t-u) dM_G(u)$
 $(D * M_G)(t)$

3] $\lim_{t \rightarrow \infty} P(I(t)=1)$

αφού $D \geq 0$

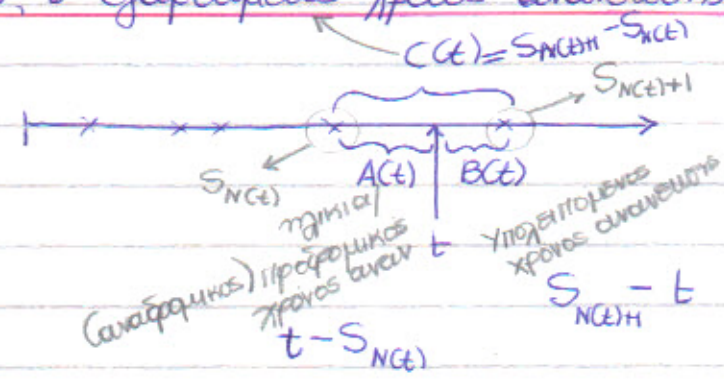
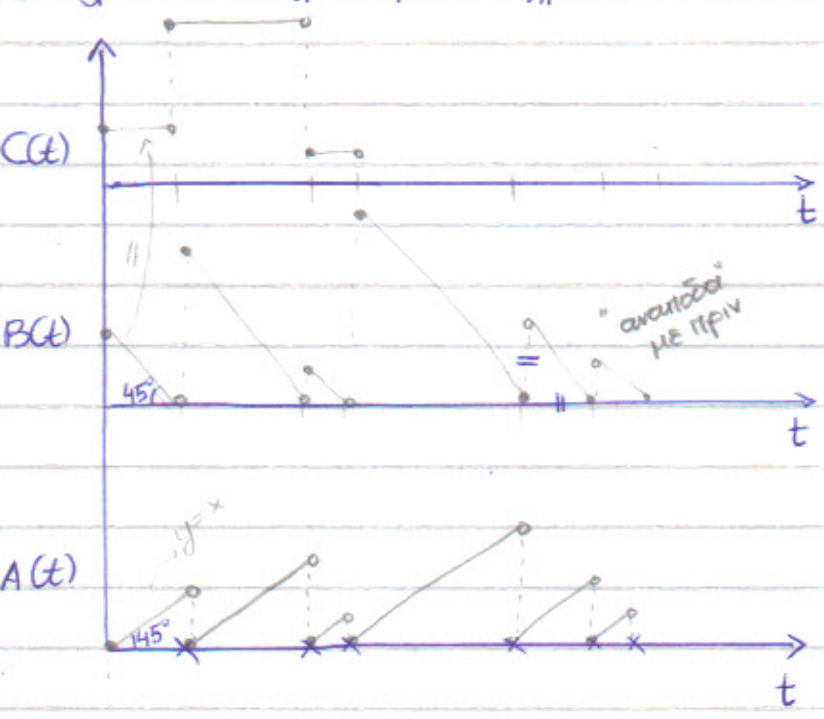
- $G(t)$ ανεξάρτητοι (Υπόθ: $G_{u,p}(t,s)$ ανεξάρτητοι)
- $D(t) = 1 - G_0(t) \geq 0$, γραμμική, μονότομη
- $\int_0^\infty |D(t)| dt = \int_0^\infty (1 - G_0(t)) dt = E[U] = \mu_U < \infty$

Αρα ισχύουν οι υποθέσεις του ΒΑΘ.

ΒΑΘ: $\lim_{t \rightarrow \infty} P(I(t)=1) = \frac{\int_0^\infty D(t) dt}{\mu} = \frac{\mu_U}{\mu_U + \mu_D}$

2ος εγγραφή, αντὶς το ① και το ③ επιπλέον θα δίνω ένα αποτέλεσμα

③ Ημίια, Υπερσυντετακτοί χρόνοι ανανεώσεως, t-εξαρτημένοι χρόνοι ανανεώσεως

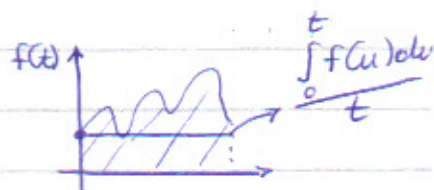


④ Υπογεωμετρικός χρόνος ανανέωσης - Μέση τιμή

$\{N(t)\}$ ανανεωτική διαδικασία με χρ. γεγονότων S_1, S_2, \dots , ειδικά μεσός
 χρ. $X_1, X_2, \dots \sim G$ με $E[X_i] = \mu_1$

$B(t) = S_{N(t)+1} - t$

1] $\lim_{t \rightarrow \infty} \frac{E\left[\int_0^t B(u) du\right]}{t}$
 μακροπρόθεσμος μέσος όρος της $\xi B(t)$



2] $E[B(t)] = ?$

3] $\lim_{t \rightarrow \infty} E[B(t)] = ?$

Λύση

1] Ορίζω $R(t) = \int_0^t B(u) du$

$(X_n, R_n) \in \mathcal{F}_n$
 $R_n = \int_{S_{n-1}}^{S_n} B(u) du = \frac{X_n^2}{2}$ (εμβαδόν σε τριγωνάκι)

Άρα $(X_n, R_n) = \left(X_n, \frac{X_n^2}{2}\right)$ ανεξ. 100% $n \geq 1$

ΣΑΘΑ: $\lim_{t \rightarrow \infty} \frac{E\left[\int_0^t B(u) du\right]}{t} = \frac{E[R_n]}{E[X_n]} = \frac{\mu_2}{2\mu_1}$

2] $H(t) = E[B(t)] = \int_0^\infty E[B(t) | X_1 = u] dG(u)$

$E[B(t) | X_1 = u] = \begin{cases} u - t & u > t \\ E[B(t-u)] & u \leq t \\ \text{"} \\ H(t-u) \end{cases}$

$$H(t) = \underbrace{\int_t^\infty (u-t) dG(u)}_{D(t)} + \int_0^t H(t-u) dG(u)$$

$$D(t) = \int_t^\infty (u-t) dG(u) = \int_t^\infty \int_0^{u-t} dx dG(u) = \int_t^\infty \int_{t+x}^\infty dG(u) dx$$

$t < u$
 $0 < x < u-t$

$$= \int_0^\infty (1 - G(t+x)) dx \stackrel{y=t+x}{=} \int_t^\infty (1 - G(y)) dy$$

Αρα, $E[B(t)] = D(t) + \int_0^t D(t-u) dH_G(u)$

3] $G(t)$ αντιστρέφω

$$D(t) = \int_t^\infty (1 - G(y)) dy \geq 0 \text{ μάλιστα, φραγμένο}$$

αφαινει με φραγισμενο τιμι ωσ
μωραει να ωραει ειαι για $t=0$
οραε $D(t) < \infty$, $D(0) = \mu = E[X]$

$$\text{ωρα } \int_0^\infty |D(t)| dt \geq \int_0^\infty \int_t^\infty \int_y^\infty (1 - G(u)) dy dt = \int_0^\infty \int_0^t \int_y^\infty dG(u) dy dt$$

$\int_y^\infty (1 - G(u)) dy = \int_y^\infty dG(u)$

$$= \int_0^\infty \int_0^u \int_0^y dt dy dG(u) = \frac{1}{2} \int_0^\infty u^2 dG(u) = \frac{1}{2} E[X^2] = \frac{\mu_2}{2} < \infty$$

$0 < t < \infty$
 $0 < y < \infty$
 $y < u < \infty$ } $0 < t < y < u$

ΒΑΘ: $\lim_{t \rightarrow \infty} E[B(t)] = \frac{\frac{\mu_2}{2}}{\mu_1} = \frac{\mu_2}{2\mu_1}$

5) Το αναμετακινούμενο παράδειγμα

$$\lim_{t \rightarrow \infty} E[B(t)] = \frac{E[X]}{2E[X]} = \frac{(E[X])^2 + V[X]}{2E[X]} = \frac{E[X]}{2} + \frac{V[X]}{2E[X]}$$

Μέσος αναμετακινούμενος χρόνος αναμετακίνησης $\geq \frac{\text{Μέσος αναμετακινούμενος χρόνος}}{2}$

$$\begin{aligned} \text{ZAGH} \Rightarrow \lim_{t \rightarrow \infty} \frac{E \left[\int_0^t \mathbb{1}_{\{B(u) > x\}} du \right]}{t} &= \lim_{t \rightarrow \infty} \frac{E[R(t)]}{t} = \frac{E[R_1]}{E[X_1]} \\ &= \frac{E[(X_1 - x)^+]}{E[X_1]} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} E[(X_1 - x)^+] &= \int_0^{\infty} P((X_1 - x)^+ > u) du = \int_0^{\infty} P(\max(X_1 - x, 0) > u) du \\ &= \int_0^{\infty} P(X_1 - x > u) du = \int_0^{\infty} P(X_1 > u+x) du \stackrel{\substack{y=u+x \\ dy=du}}{=} \int_x^{\infty} P(X_1 > y) dy \\ &= \int_x^{\infty} (1 - G(y)) dy \end{aligned}$$

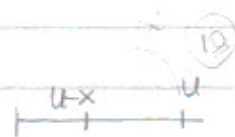
$$\text{Ара, } \lim_{t \rightarrow \infty} \frac{E \left[\int_0^t \mathbb{1}_{\{B(u) > x\}} du \right]}{t} = \frac{\int_x^{\infty} (1 - G(y)) dy}{\mu}$$

2) Эсая $H(t) = P(B(t) > x)$. Аэоремия эов X_1 .

$$H(t) = \int_0^{\infty} P(B(t) > x | X_1 = u) dG(u)$$

$$P(B(t) > x | X_1 = u) = \begin{cases} P(B(t-u) > x) & , u \leq t \\ 0 & , u > t \\ 1 & , u-x \leq t < u \\ t & , t < u-x \end{cases}$$

$$H(t) = \int_{x+t}^{\infty} dG(u) + \int_0^t H(t-u) dG(u) = \underbrace{1 - G(x+t)}_{D(t)} + \int_0^t H(t-u) dG(u)$$



Λίστα: $P(B(t) > x) = H(t) = D(t) + \int_0^t D(t-u) dM_G(u) = 1 - G(x+t) + \int_0^t (1 - G(x+t-u)) dM_G(u)$

3) G συνεχής \Rightarrow απεριοδίμη

• $D(t) = 1 - G(x+t) \geq 0$ φραγμένη, \downarrow
 • $\int_0^\infty |D(t)| dt = \int_0^\infty D(t) dt = \int_0^\infty (1 - G(t+x)) dt \stackrel{t+x=y}{=} \int_x^\infty (1 - G(y)) dy \leq \int_0^\infty (1 - G(y)) dy = \mu < \infty$

ΒΑΘ $\Rightarrow P(B(t) > x) = \frac{\int_0^\infty D(t) dt}{\mu} = \frac{\int_x^\infty (1 - G(y)) dy}{\mu}$

5) Πρόταση:

$\lim_{t \rightarrow \infty} \frac{E\left[\int_0^t 1_{\{B(u) \leq x\}} du\right]}{t} = \lim_{t \rightarrow \infty} P(B(t) \leq x)$

$= 1 - \frac{\int_x^\infty (1 - G(y)) dy}{\mu} \stackrel{\text{απόλυτο τιτ}}{=} \frac{\int_0^x (1 - G(y)) dy}{\mu} \leftarrow \text{Κατανομή ισορροπίας της } G$
 $G_e(x)$

Αναθεώρηση: $G(x) \longrightarrow G_e(x)$
 Κατανομή \longrightarrow Κατανομή
 εδωκεσών χρόνων \longrightarrow ισορροπημένα χρόνια
 ανανεώσεων \longrightarrow ανανεώσεων

6) Παρατηρήσεις της $G_e(x)$

Έστω $G(x)$ οκ με $E[X] = \mu$, $\text{Var}[X] = \sigma^2$, μετασχηματισμός LS $\tilde{G}(s)$
 και $G_e(x)$ η αντίστοιχη κατανομή ισορροπίας

$$G_e(x) = \frac{\int_0^x (1 - G(y)) dy}{\mu}, \quad x \geq 0$$

στην: $g_e(x) = \frac{1 - G(x)}{\mu}, \quad x \geq 0$

$$E[X_e] = \frac{\mu}{2} + \frac{\sigma^2}{2\mu}$$

μετασχηματισμός L-S: $\frac{1 - \tilde{G}(s)}{\mu s}$

$$\begin{aligned} \text{Απόδ: } \tilde{G}_e(s) &= \int_0^{\infty} e^{-sx} dG_e(x) = \frac{1}{\mu} \int_0^{\infty} e^{-sx} (1 - G(x)) dx \\ &= \frac{1}{\mu} \int_0^{\infty} e^{-sx} \int_x^{\infty} dG(y) dx = \frac{1}{\mu} \int_0^{\infty} \int_0^y e^{-sx} dx dG(y) \\ &= \frac{1}{\mu s} \left(\int_0^{\infty} dG(y) - \int_0^{\infty} e^{-sy} dG(y) \right) \\ &= \frac{1}{\mu s} (1 - \tilde{G}(s)) \end{aligned}$$

⊕ Κλασικά ζευγ $G(x), G_e(x)$

$G(x) = \begin{cases} 0, & x < c \\ 1, & x \geq c \end{cases}$	$G_e(x) = \frac{1}{c}, \quad 0 \leq x \leq c$
<ul style="list-style-type: none"> • $\text{Exp}(\lambda)$ • Erlang(2, λ) 	<ul style="list-style-type: none"> • $\text{Exp}(\lambda)$ • Mign $\text{Exp}(\lambda), \text{Erlang}(2, \lambda)$ με π.θ. $\frac{1}{2} \kappa, \frac{1}{2}$

8) Μέγεθος του $A(t)$

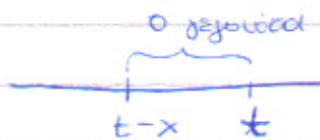
$$\lim_{t \rightarrow \infty} E[A(t)] = \frac{\mu}{2} + \frac{\sigma^2}{2\mu}$$

τα ίδια με τα αποτελέσματα της $B(t)$

$$\lim_{t \rightarrow \infty} P(A(t) \leq x) = \frac{\int_0^x (1 - G(y)) dy}{\mu}$$

$\forall \{A(t) > x\}$

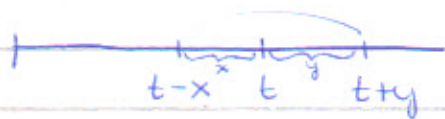
= $\{οχι ανανεωμένα γεγονότα στο $(t-x, t)\}$ = $\{B(t-x) > x\}$$



$$\lim_{t \rightarrow \infty} P(A(t) > x) = \lim_{t \rightarrow \infty} P(B(t-x) > x) = \lim_{y \rightarrow \infty} P(B(y) > x) = \frac{\int_x^{\infty} (1 - G(y)) dy}{\mu}$$

9) Μέγεθος του $(A(t), B(t))$

$$P(A(t) > x, B(t) > y) = P(\text{οχι ανανεωμένα γεγονότα στο } t-x, t+y)$$



$$= P(B(t-x) > x+y)$$

$$\lim_{t \rightarrow \infty} P(A(t) > x, B(t) > y) = \lim_{t \rightarrow \infty} P(B(t-x) > x+y) = \lim_{s \rightarrow \infty} P(B(s) > x+y)$$

$$= \frac{\int_{x+y}^{\infty} (1 - G(u)) du}{\mu}$$

\forall Για $G \sim \text{Exp}$, τότε $A(t)$ και $B(t)$ ανεξ.

10) Μέγεθος του $C(t)$

$$\text{Έστω } C(t) = A(t) + B(t)$$

$$\lim_{t \rightarrow \infty} E[C(t)] = 2 \left(\frac{\mu}{2} + \frac{\sigma^2}{2\mu} \right) = \mu + \frac{\sigma^2}{\mu}$$