

## PROBABILIDAD Y ESTADÍSTICA II

# TEMA 1.2 CADENAS DE MARKOV EN TIEMPO CONTINUO

Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo

Probabilidad y Estadística II

### CONTENIDOS

1. Definición de Cadena de Markov en Tiempo Continuo
2. Comportamiento de transición
3. Comportamiento estacionario
4. Procesos de nacimiento y muerte

CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70

---

ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70

Cartagena99

### 1. Definición de Cadena de Markov en Tiempo Continuo

Un proceso estocástico en tiempo continuo  $\{X(t), t \geq 0\}$  con espacio de estados  $S$  (enteros no negativos) es una **cadena de Markov en tiempo continuo** si

$$P(X(t) = j \mid X(s) = i, X(t_{n-1}) = i_{n-1}, \dots, X(t_1) = i_1) \\ = P(X(t) = j \mid X(s) = i)$$

donde  $0 \leq t_1 \leq t_2 \leq \dots \leq t_{n-1} \leq s \leq t$  es cualquier secuencia no decreciente de  $n+1$  tiempos e  $i_1, i_2, \dots, i_{n-1}, i, j \in S$  son  $n+1$  estados cualesquiera del conjunto  $S$ .

La CMTC verifica la propiedad de Markov  $\rightarrow$  que dado el estado del proceso en un conjunto de tiempos anteriores al instante  $t$ , la distribución del proceso en el instante  $t$  depende sólo del instante de tiempo anterior más próximo a  $t$ .

Una cadena de Markov en tiempo continuo es **homogénea** si para cada  $s \leq t$  y cada estado  $i, j \in S$ ,

$$P(X(t) = j \mid X(s) = i) = P(X(t-s) = j \mid X(0) = i)$$

No todas las CMTC tienen que ser homogéneas, pero consideraremos únicamente las CMTC homogéneas.

Por homogeneidad, cuando el proceso entra en el estado  $i$ , la forma de evolucionar probabilísticamente desde este punto es la misma que si el proceso comenzase en el estado  $i$  en el instante 0. Denotamos al tiempo de permanencia del proceso en el estado  $i$  como  $T_i$ .

CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70

---

ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70

Cartagena99

**Definición alternativa de CMTC.** Un proceso estocástico en tiempo continuo  $\{X(t), t \geq 0\}$  es una cadena de Markov en tiempo continuo si:

- Cuando entra en un estado  $i$ , el tiempo que permanece en él se distribuye exponencialmente con media  $1/\nu_i$ .
- Cuando abandona el estado  $i$ , entra en el estado  $j$  con probabilidad de transición  $p_{ij}$ , con  $p_{ii} = 0$  y  $\sum_j p_{ij} = 1$ .

La matriz  $\mathbf{P}$ , formada por las probabilidades  $p_{ij}$ , es una matriz estocástica y, por lo tanto, la matriz de probabilidades de transición en un paso de una CMTD. Designaremos a esta CMTD como la cadena de Markov encajada.

Una CMTC se comporta como una CMTD, pero con intervalos de tiempo de permanencia en cada estado distribuidos exponencialmente e independientes.

**Ejemplos: Proceso de Poisson de tasa 1, Proceso de Yule y Sistema de dos procesadores secuenciales.**

## 2. Comportamiento de transición

En las CMTD se estudiaron las probabilidades de transición en  $n$  pasos,  $p_{ij}^{(n)}$ . El homólogo en CMTC es la **función de probabilidad de transición**

$$p_{ij}(t) = P(X(t) = j \mid X(0) = i),$$

es decir, la probabilidad de que estando inicialmente en el estado  $i$ , después de  $t$  unidades de tiempo estemos en el estado  $j$ .

En las CMTC no podemos hablar de pasos. Para cada par de estados  $i, j \in S$ , la función de probabilidad de transición  $p_{ij}(t)$  es una función continua de  $t$ .

En general, es difícil o imposible determinar la función de probabilidad de transición aunque en casos sencillos se puede calcular. Por ejemplo, en los

CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70

---

ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70

Cartagena99

**Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo****Probabilidad y Estadística II**

Los valores fundamentales que especificaban una CMTD eran las probabilidades de transición  $p_{ij}$ . En tiempo continuo, son las **tasas instantáneas de transición**  $q_{ij} = v_i p_{ij}$ , que representan la tasa a la que se hacen transiciones de  $i$  a  $j$ .

**Proposición 2** (Ecuaciones de Chapman-Kolmogorov). Sea la CMTD  $\{X(t), t \geq 0\}$  con espacio de estados  $S$ . Entonces, para cada  $s, t \geq 0$ ,

$$p_{ij}(t+s) = \sum_{k \in S} p_{ik}(t) p_{kj}(s).$$

**Objetivo:** proporcionar un stma. de ecuac. diferenciales para calcular  $p_{ij}(t)$ .

**Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo****Probabilidad y Estadística II**

$$\begin{aligned} p'_{ij}(t) &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{p_{ij}(t+h) - p_{ij}(t)}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{\sum_{k=0}^{\infty} p_{ik}(t) p_{kj}(h) - p_{ij}(t)}{h} \\ &= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{\sum_{k \neq j} p_{ik}(t) p_{kj}(h) - p_{ij}(t)(1 - p_{jj}(h))}{h} \\ &= \sum_{k \neq j} p_{ik}(t) \lim_{h \rightarrow 0} \frac{p_{kj}(h)}{h} - p_{ij}(t) \lim_{h \rightarrow 0} \frac{1 - p_{jj}(h)}{h}. \end{aligned}$$

Después de operar obtenemos que

$$p'_{ij}(t) = \sum_{k \neq j} p_{ik}(t) \lim_{h \rightarrow 0} \frac{p_{kj}(h)}{h} - p_{ij}(t) \lim_{h \rightarrow 0} \frac{1 - p_{jj}(h)}{h}$$

**CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70**

---

**ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70**

Cartagena99

## Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo

## Probabilidad y Estadística II

**Teorema 1** (Ecuaciones diferenciales hacia atrás de Kolmogorov). Bajo condiciones adecuadas,  $\forall i, j, t \geq 0$

$$p'_{ij}(t) = \sum_{k \neq j}^{\infty} p_{ik}(t) q_{kj} - p_{ij}(t) v_j.$$

**Ejemplo (Continuación del ejemplo de Proceso de Poisson de tasa  $\lambda$ )**  
Como  $q_{i,i+1} = v p_{i,i+1} = v_i = \lambda$  y  $q_{ij} = v p_{ij} = 0, \forall j \neq i + 1$ , las ecuaciones diferenciales hacia atrás de Kolmogorov son

$$p'_{ij}(t) = p_{i,j-1}(t) \lambda - p_{ij}(t) \lambda.$$

**Ejemplo (Continuación del ejemplo de Proceso de Yule)** Como  $q_{i,i+1} = v p_{i,i+1} = i \lambda$  y  $q_{ij} = v p_{ij} = 0, \forall j \neq i + 1$ , las ecuaciones diferenciales hacia atrás de Kolmogorov son

$$p'_{ij}(t) = p_{i,j-1}(t) (j - 1) \lambda - p_{ij}(t) j \lambda.$$

## Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo

## Probabilidad y Estadística II

Las ecuaciones diferenciales hacia atrás de Kolmogorov en forma matricial:

$$\mathbf{P}_0(t) = \mathbf{G} \mathbf{P}(t),$$

donde  $\mathbf{P}(t)$  y  $\mathbf{P}_0(t)$  las matrices formadas por los elementos  $p_{ij}(t)$  y  $p'_{ij}(t)$ , respectivamente, y  $\mathbf{G}$  (**generador infinitesimal o generador**) en la que los elementos  $(i, i)$  tienen valor  $-v_i$  y los elementos  $(i, j)$ , con  $i \neq j$ , el valor  $q_{ij}$ .

Las CMTC se pueden representar mediante un **diagrama de transición**: grafo en el que los nodos representan estados, un arco entre  $i$  y  $j$  describe la posibilidad de transición de  $i$  a  $j$  y  $q_{ij}$  se representa sobre el arco correspondiente.

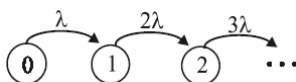
CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70

---

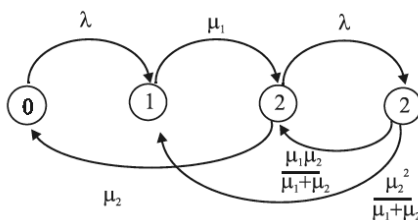
ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP: 689 45 44 70

Cartagena99

Ejemplo (Continuación del ejemplo de Proceso de Yule)



Ejemplo (Continuación del ejemplo de Sistema con dos procesadores secuenciales)



3. Comportamiento estacionario

Sea  $\{X(t), t \geq 0\}$  una CMTC con matriz de funciones de probabilidad de transición  $\mathbf{P}(t)$ . Un vector  $\pi$ , con  $\pi_i \geq 0 \forall i$  y  $\sum_i \pi_i = 1$ , se dice que es una distribución estacionaria si  $\pi = \pi \mathbf{P}(t), \forall t \geq 0$ .

Veamos cómo utilizar el generador  $\mathbf{G}$  para determinar la distribución estacionaria:

$$\begin{aligned} \pi \text{ es estacionaria} &\Leftrightarrow \pi = \pi \mathbf{P}(t), \forall t \geq 0 \Leftrightarrow \pi = \pi \sum_{n=0}^{\infty} \frac{(t\mathbf{G})^n}{n!}, \forall t \geq 0 \\ &\Leftrightarrow \mathbf{0} = \sum_{n=1}^{\infty} \frac{t^n}{n!} \pi \mathbf{G}^n, \forall t \geq 0 \Leftrightarrow \mathbf{0} = \pi \mathbf{G}^n, \forall n \geq 1 \\ &\Leftrightarrow \mathbf{0} = \pi \mathbf{G}. \end{aligned}$$

CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70

---

ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70



## Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo

## Probabilidad y Estadística II

$$\begin{cases} \mathbf{0} = \boldsymbol{\pi} \mathbf{G} \\ \sum_i \pi_i = 1 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} 0 = -v_j \pi_j + \sum_{i \neq j} q_{ij} \pi_i \\ \sum_i \pi_i = 1 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} v_j \pi_j = \sum_{i \neq j} q_{ij} \pi_i \\ \sum_i \pi_i = 1 \end{cases}$$

Lado izquierdo  $\rightarrow \pi_j$  es la proporción de tiempo a largo plazo que el proceso está en el estado  $j$ , mientras que  $v_j$  es la tasa de abandono del estado  $j$  cuando el proceso está en él. Así,  $v_j \pi_j$  es interpretado como la tasa a largo plazo de dejar el estado  $j$ .

Lado derecho  $\rightarrow q_{ij}$  es la tasa de ir al estado  $j$  cuando el proceso está en el estado  $i$ , así  $q_{ij} \pi_i$  se interpreta como la tasa a largo plazo de ir del estado  $i$  al  $j$ . Luego,  $\sum_{i \neq j} q_{ij} \pi_i$  representa la tasa a largo plazo de ir al estado  $j$ .

Por lo tanto, la tasa a largo plazo de salida del estado  $j$  coincide con la tasa de entrada en el estado  $j$ , y por esta razón las ecuaciones  $0 = \boldsymbol{\pi} \mathbf{G}$  se denominan **ecuaciones de equilibrio global** o simplemente **ecuaciones de equilibrio**.

## Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo

## Probabilidad y Estadística II

**Teorema 2.** En una cadena de Markov en tiempo continuo, si existe una distribución estacionaria  $\boldsymbol{\pi}$ , entonces es única y

$$\lim_{t \rightarrow \infty} p_{ij}(t) = \pi_j, \quad \forall i.$$

**Ejemplo (Continuación del ejemplo de proceso de Poisson de tasa  $\lambda$ )** Las ecuaciones de equilibrio para un proceso de Poisson de tasa  $\lambda$  son

$$\begin{cases} \lambda \pi_j = \lambda \pi_{j-1}, \quad \forall j \\ \sum_i \pi_i = 1 \end{cases} \quad \text{que no tienen solución.}$$

**Ejemplo (Continuación del ejemplo de proceso de Yule)** Las ecuaciones

CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70

---

ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70

Cartagena99

4. Procesos de Nacimiento y Muerte

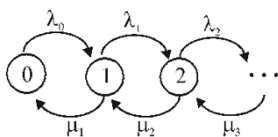
Los procesos de nacimiento y muerte, básicamente, describen sistemas cuyo estado, en cada instante, representa el número de individuos en el mismo. Cuando éste es  $n$ , se producen llegadas con tasa exponencial  $\lambda_n$  y salidas con tasa exponencial  $\mu_n$ , de forma independiente.

Un proceso de nacimiento y muerte con tasas de llegada (nacimiento)  $\{\lambda_n\}_{n=0}^\infty$  y tasas de salida (muerte)  $\{\mu_n\}_{n=1}^\infty$  es una CMTC con espacio de estados  $\{0, 1, 2, \dots\}$ , tasas de permanencia  $v_0 = \lambda_0, v_i = \lambda_i + \mu_i, i > 0$  y probabilidades de transición

$$\begin{aligned}
 p_{01} &= 1, & p_{0i} &= 0, \text{ para } i \neq 1, \\
 p_{i,i+1} &= \frac{\lambda_i}{\lambda_i + \mu_i}, & p_{i,i-1} &= \frac{\mu_i}{\lambda_i + \mu_i}, \\
 p_{ij} &= 0, \text{ } j \neq i+1, i-1, \text{ para } i \neq 0.
 \end{aligned}$$

El proceso de Poisson es un proceso de nacimiento y muerte con  $\lambda_n = \lambda$  y  $\mu_n = 0, \forall n$ . El proceso de Yule es también un proceso de nacimiento y muerte con  $\lambda_n = n\lambda$  y  $\mu_n = 0, \forall n$ .

El diagrama de transición de un proceso de nacimiento y muerte es



Sus tasas de transición son

$$q_{01} = \lambda_0, q_{i,i+1} = \lambda_i, q_{i,i-1} = \mu_i,$$

y el resto 0, con lo que el sistema de ecuaciones diferenciales de Kolmogorov es

CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70

---

ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70





**Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo****Probabilidad y Estadística II**

Resolverlo es complicado, pero conducen de forma sencilla al sistema en equilibrio

$$\begin{aligned}\lambda_0 \pi_0 &= \mu_1 \pi_1 \\ (\lambda_j + \mu_j) \pi_j &= \mu_{j+1} \pi_{j+1} + \lambda_{j-1} \pi_{j-1}, \quad j = 1, 2, \dots \\ \sum_j \pi_j &= 1\end{aligned}$$

o bien

$$\begin{aligned}\lambda_0 \pi_0 &= \mu_1 \pi_1 \\ (\lambda_1 + \mu_1) \pi_1 &= \mu_2 \pi_2 + \lambda_0 \pi_0 \\ (\lambda_2 + \mu_2) \pi_2 &= \mu_3 \pi_3 + \lambda_1 \pi_1 \\ \dots & \\ (\lambda_n + \mu_n) \pi_n &= \mu_{n+1} \pi_{n+1} + \lambda_{n-1} \pi_{n-1} \\ \dots & \\ \sum_n \pi_n &= 1\end{aligned}$$

descrito mediante el equilibrio de tasas de salida y de entrada en cada estado.

**Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo****Probabilidad y Estadística II**

La resolución del sistema es estándar, sumando las dos primeras, las tres primeras, ecuaciones pasamos al sistema

$$\begin{array}{ll} \lambda_0 \pi_0 = \mu_1 \pi_1 & \pi_1 = \frac{\lambda_0}{\mu_1} \pi_0 \\ \lambda_1 \pi_1 = \mu_2 \pi_2 & \pi_2 = \frac{\lambda_1}{\mu_2} \pi_1 = \frac{\lambda_1 \lambda_0}{\mu_2 \mu_1} \pi_0 \\ \lambda_2 \pi_2 = \mu_3 \pi_3 & \pi_3 = \frac{\lambda_2}{\mu_3} \pi_2 = \frac{\lambda_2 \lambda_1 \lambda_0}{\mu_3 \mu_2 \mu_1} \pi_0 \\ \dots & \dots \\ \lambda_n \pi_n = \mu_{n+1} \pi_{n+1} & \pi_n = \frac{\lambda_{n-1}}{\mu_n} \pi_{n-1} = \frac{\lambda_{n-1} \dots \lambda_0}{\mu_n \dots \mu_1} \pi_0 \\ \dots & \dots \\ \sum_n \pi_n = 1 & \sum_n \pi_n = 1 \end{array}$$

y despejando  
cada  $\pi_i$  en  
función de  $\pi_0$

**CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70**

---

**ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70**

Cartagena99

## Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo

## Probabilidad y Estadística II

$$\pi_0 = \frac{1}{1 + \sum_{n=1}^{\infty} \frac{\lambda_{n-1} \cdots \lambda_0}{\mu_n \cdots \mu_1}}$$

con lo cual,

$$\pi_n = \frac{\lambda_{n-1} \cdots \lambda_0}{\mu_n \cdots \mu_1 \left( 1 + \sum_{n=1}^{\infty} \frac{\lambda_{n-1} \cdots \lambda_0}{\mu_n \cdots \mu_1} \right)}$$

Claramente, una condición necesaria para que exista la distribución estacionaria es que

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{\lambda_{n-1} \cdots \lambda_0}{\mu_n \cdots \mu_1} < \infty.$$

comprobándose que esta condición es también suficiente para la existencia de la distribución.

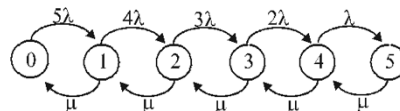
## Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo

## Probabilidad y Estadística II

**Ejemplo.** En una empresa hay 5 servidores y un técnico que los mantiene.

Supongamos que el tiempo que tardan en fallar sigue una distribución exponencial con tasa 1 fallo cada 10 horas. La duración de la reparación es exponencial con media 2 horas. ¿Cuál es el número medio de servidores con fallos? y ¿qué proporción de tiempo a largo plazo está cada servidor en uso?

Diremos que el sistema está en el estado  $n$  si hay  $n$  servidores con fallos. Entonces, el problema puede ser modelizado como un proceso de nacimiento y muerte con diagrama de transición



CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70

---

ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70

Cartagena99

**Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo****Probabilidad y Estadística II**

Las ecuaciones en equilibrio son

$$\left\{ \begin{array}{l} 5\lambda\pi_0 = \mu\pi_1 \\ (4\lambda + \mu)\pi_1 = 5\lambda\pi_0 + \mu\pi_2 \\ (3\lambda + \mu)\pi_2 = 4\lambda\pi_1 + \mu\pi_3 \\ (2\lambda + \mu)\pi_3 = 3\lambda\pi_2 + \mu\pi_4 \\ (\lambda + \mu)\pi_4 = 2\lambda\pi_3 + \mu\pi_5 \\ \mu\pi_5 = \lambda\pi_4 \\ \sum_{i=0}^5 \pi_i = 1 \end{array} \right. \Rightarrow \left\{ \begin{array}{l} 5\lambda\pi_0 = \mu\pi_1 \\ 4\lambda\pi_1 = \mu\pi_2 \\ 3\lambda\pi_2 = \mu\pi_3 \\ 2\lambda\pi_3 = \mu\pi_4 \\ \lambda\pi_4 = \mu\pi_5 \\ \sum_{i=0}^5 \pi_i = 1 \end{array} \right.$$

y sustituyendo por su valor se obtiene

$$\left\{ \begin{array}{l} 5/10\pi_0 = 1/2\pi_1 \\ 4/10\pi_1 = 1/2\pi_2 \\ 3/10\pi_2 = 1/2\pi_3 \\ 2/10\pi_3 = 1/2\pi_4 \\ 1/10\pi_4 = 1/2\pi_5 \\ \sum_{i=0}^5 \pi_i = 1 \end{array} \right. \Rightarrow \left\{ \begin{array}{l} \pi_0 = 0.02734 \\ \pi_1 = 0.02734 \\ \pi_2 = 0.03416 \\ \pi_3 = 0.05694 \\ \pi_4 = 0.14237 \\ \pi_5 = 0.71185 \end{array} \right.$$

**Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo****Probabilidad y Estadística II**

Por lo tanto, el número medio de servidores con fallos es  $\sum_{n=0}^5 n\pi_n = 4.395$  y la proporción de tiempo a largo plazo que está cada servidor en uso es (teorema de la probabilidad total).

$$\begin{aligned} P(\text{servidor sin fallos}) &= \sum_{n=0}^5 P(\text{servidor sin fallos} \mid n \text{ servidores con fallos}) \pi_n \\ &= \sum_{n=0}^5 \frac{5-n}{5} \pi_n = 0.121. \end{aligned}$$

**CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70**

---

**ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70**

Cartagena99

**Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo****Probabilidad y Estadística II**

Consideremos un proceso de nacimiento y muerte general con tasas  $\{\lambda_n\}_{n=0}^{\infty}$  y  $\{\mu_n\}_{n=1}^{\infty}$ . **Tiempo que tarda el sistema en pasar del estado  $i$  al  $i+1$** , es decir,  $T_i$ ,  $i \geq 0$ . Calculemos  $E(T_i)$  de forma recursiva.

En primer lugar, como  $T_0 \sim \text{Exp}(\lambda_0)$  se tiene que  $E(T_0) = 1/\lambda_0$ . Para  $i > 0$ , condicionamos a que la primera transición sea a  $i-1$  o a  $i+1$ . Para ello, definimos

$$I_i = \begin{cases} 1, & \text{si la primera transición es de } i \text{ a } i+1 \\ 0, & \text{si la primera transición es de } i \text{ a } i-1 \end{cases}$$

Se tiene

$$E(T_i | I_i = 1) = \frac{1}{\lambda_i + \mu_i}$$

$$E(T_i | I_i = 0) = \frac{1}{\lambda_i + \mu_i} + E(T_{i-1}) + E(T_i)$$

pues, independientemente de que la primera transición sea por nacimiento o muerte, se produce con tasa  $1/(\lambda_i + \mu_i)$ .

**Tema 1.2 Cadenas de Markov en Tiempo Continuo****Probabilidad y Estadística II**

Luego,

$$\begin{aligned} E(T_i) &= E(E(T_i | I_i)) = E(T_i | I_i = 1) P(I_i = 1) + E(T_i | I_i = 0) P(I_i = 0) \\ &= \frac{1}{\lambda_i + \mu_i} \frac{\lambda_i}{\lambda_i + \mu_i} + \left( \frac{1}{\lambda_i + \mu_i} + E(T_{i-1}) + E(T_i) \right) \frac{\mu_i}{\lambda_i + \mu_i} \\ &= \frac{1}{\lambda_i + \mu_i} + \frac{\mu_i}{\lambda_i + \mu_i} (E(T_{i-1}) + E(T_i)), \end{aligned}$$

de donde

$$E(T_i) = \frac{1}{\lambda_i} + \frac{\mu_i}{\lambda_i} E(T_{i-1}).$$

Así, si deseamos calcular el tiempo esperado para ir del estado  $i$  al  $j$ , con  $i < j$ , tenemos que éste vale:

**CLASES PARTICULARES, TUTORÍAS TÉCNICAS ONLINE  
LLAMA O ENVÍA WHATSAPP: 689 45 44 70**

---

**ONLINE PRIVATE LESSONS FOR SCIENCE STUDENTS  
CALL OR WHATSAPP:689 45 44 70**

Cartagena99