

ABSTRAK

Proses Markov adalah proses stokastik dimana masa lalu tidak mempunyai pengaruh pada masa yang akan datang apabila masa sekarang diketahui. Contoh dari proses Markov adalah gerak Brown.

Dalam tulisan ini metode yang digunakan adalah pembahasan secara teoritis. Proses $B = \{B_t, \mathcal{F}_t; t \geq 0\}$ dengan $B_{t+s} - B_s$ merupakan penambahan independen dengan $0 \leq s < t+s$ adalah gerak Brown berdimensi d dengan distribusi awal μ . Proses ini merupakan suatu proses Markov berdimensi d .

