

<<随机过程论(第二版)>>

图书基本信息

书名：<<随机过程论(第二版)>>

13位ISBN编号：9787301035474

10位ISBN编号：7301035470

出版时间：1997-10

出版时间：北京大学出版社

作者：钱敏平

页数：406

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<随机过程论(第二版)>>

### 前言

近三十年来，随机过程论在理论与应用两方面都发展迅速。学习、了解这个学科不仅对于概率统计方面的工作者是必要的，而且对数学的其它分支、自然科学、工程技术，乃至经济管理等方面的学者及科技工作者都是重要而有益的。这方面的有关教材无论中文的或外文的都已不少，它们各有特色。在这众多的教材出现之后，笔者又以本书奉献给读者，希望在两个方面有其特点。其一是：过去的教材大都属于两类之一，一类是严格的数学论述；另一类偏重应用，但不求数学严格性。本书力图能兼顾二者，一方面尽量阐明理论的来源、背景及模型；另一方面，对基本的理论又给出严格的数学定义、定理及论证，以期适应理论与应用两方面。

## <<随机过程论(第二版)>>

### 内容概要

本书是随机过程的基础入门读物，主要讲授随机过程论的基本理论和方法，包括：基本概念、鞅论、马氏链、Q过程、Brown运动、马氏过程、相互作用粒子系、渗流与点过程的数学模型、扩散过程与随机分析、平稳过程与遍历理论等。

本书兼顾严格的数学论证与阐明理论的来源、背景及模型，反遇了近年来的成果、观点与倾向，对一些基本的经典问题采用了新的处理方法。

本书可供高等院校高年级学生、研究生及一般科技工作者学习参考。

## &lt;&lt;随机过程论(第二版)&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 引论 1 随机过程的概念与例子 2 Kolmogorov定理与可分性 3 独立增量过程与鞅 4 Markov过程 5 Gauss系 6 平稳过程与宽平稳过程 习题第二章 鞅论初步 1 上鞅、下鞅的概念、简单性质与分解定理 2 停时与鞅的停时定理 3 不等式、收敛定理 4 停时定理 5 修正定理 习题第三章 可数状态马氏过程——马氏链 1 离散时间时齐马氏链 2 弱遍历定理与不变测度 3 强马氏过程、强遍历性与平均回访时间 4 转移概率的极限 习题第四章 Q-过程 1 连续时间参数马氏链的转移密度阵 2 连续以数马氏链的强马氏性、嵌入链与Q-过程的电小解 3 对称必与可逆性 习题第五章 Brown运动 1 Brown分布及其性质 2 Brown运动的存在性及其轨道性质 3 Brown运动与停时 习题第六章 马氏过程 1 马氏过程与半群及鞅问题 2 强马氏性、过程的截止与Feymann-Kac公式 3 度量空间中测度的弱收敛及马氏过程 在C空间与D空间的实现 习题第七章 相互作用粒子系、渗流与点过程的数学模型 1 相互作用粒子系的数学模型 2 渗流问题与随机介质的概率模型 3 点过程模型第八章 扩散过程与随机分析初步第九章 平稳过程与遍历理论初步附录一般记号特殊记号首次出现的面码数名词索引参考书目

<<随机过程论(第二版)>>

编辑推荐

《随机过程论》可供高等院校高年级学生、研究生及一般科技工作者学习参考。

<<随机过程论(第二版)>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>