

<<随机过程初级教程>>

图书基本信息

书名：<<随机过程初级教程>>

13位ISBN编号：9787115163370

10位ISBN编号：7115163375

出版时间：2007-9

出版时间：人民邮电

作者：卡林

页数：503

字数：632000

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>

<<随机过程初级教程>>

内容概要

本书系统论述随机过程的基本理论和方法,理论与实际应用并重。

主要内容有:马尔可夫链、连续时间马尔可夫链、更新过程、鞅论、布朗运动、分支过程和平稳随机过程等。

本书涉及范围十分广泛,含有丰富的背景知识。

深入浅出,不需要测度论作为预备知识。

本书可作为高等学校本科生和研究生的教材,也可作为工程技术人员的参考书。

<<随机过程初级教程>>

作者简介

Samuel Karlin 斯坦福大学荣休教授，国际著名的应用概率学家，美国科学院院士，数理统计学会会士。

1987年获冯·诺伊曼奖。

在生灭过程中计算平稳分布的Karlin-McGregor定理即以他的名字命名。

Howard M. Taylor 康奈尔大学荣休教授，国际著名的应用概率学家，与Frederick Hillier和Sheldon Ross等名家同门，师从Gerald Lieberman。

<<随机过程初级教程>>

书籍目录

第1章 随机过程初步	1.1 基本术语、随机变量和分布函数性质的复习	1.2 随机过程的两个简单例子
1.3 一般随机过程的分类	1.4 随机过程的确定	初等问题 问题 附记
参考书目	第2章 马尔可夫链	2.1 定义
2.2 马尔可夫链的例子	2.3 马尔可夫链的转移概率矩阵	2.4 马尔可夫链的状态分类
2.5 常返性	2.6 常返马尔可夫链的例子	2.7 关于常返性的补充
初等问题 问题 附记	参考书目	第3章 马尔可夫链的基本极限定理和应用
3.1 离散更新方程	3.2 定理1.1的证明	3.3 吸收概率
3.4 常返性准则	3.5 一个排队例子	3.6 另一个排队模型
3.7 随机游动	初等问题 问题 附记	参考书目
第4章 连续时间马尔可夫链的古典例子	4.1 一般纯生过程和泊松过程	4.2 泊松过程的补充
4.3 计数模型	4.4 生灭过程	4.5 生灭过程的微分方程
4.6 生灭过程的例子	4.7 带有吸收状态的生灭过程	4.8 有限状态连续时间马尔可夫链
初等问题 问题 附记	参考书目	第5章 更新过程
5.1 更新过程的定义和有关概念	5.2 更新过程的一些例子	5.3 若干特殊更新过程的补充
5.4 更新方程和初等更新定理	5.5 更新定理	5.6 更新定理的应用
5.7 更新过程的推广	5.8 更新理论更复杂的应用	5.9 更新过程的叠加
初等问题 问题 参考书目	第6章 鞅	6.1 初步定义和例子
6.2 上鞅和下鞅	6.3 可选抽样定理	6.4 可选抽样定理的若干应用
6.5 鞅收敛定理	6.6 鞅收敛定理的应用和扩展	6.7 关于域族的鞅
6.8 其他类型的鞅	初等问题 问题 附记	参考书目
第7章 布朗运动	第8章 分支过程	第9章 平稳过程
附录 矩阵分析的复习	索引	

<<随机过程初级教程>>

编辑推荐

《随机过程初级教程》(第2版)可作为高等学校本科生和研究生的教材,也可作为工程技术人员的参考书。

<<随机过程初级教程>>

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>