

<<概率论>>

图书基本信息

书名：<<概率论>>

13位ISBN编号：9787506283403

10位ISBN编号：7506283409

出版时间：2007-10

出版时间：Thomson, Brooks Cole

作者：杜雷特

页数：497

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>

## <<概率论>>

### 内容概要

本书由美国康奈尔大学Rick Durrett教授撰写，书中反映了过去半个多世纪概率论与随机过程的巨大发展，体现了概率论与其他学科深刻联系以及在工程、经济、金融等方面的应用，继承了美国在概率论教育实践中所积累的经验。

本书选材恰当，编排合理，难度适中，兼顾理论与应用，契合当今研究生教学的实际情况，被美国多所著名高校选为研究生教材。

本书内容包括大数定律、中心极限定理、随机游动、鞅论、马氏链、遍历定理、布朗运动等。

附录部分收录了所需的测度论知识。

此书宜为概率统计专业研究生教材。

对于学过概率论的学者而言，这也不失为一本出色的参考书。

<<概率论>>

作者简介

作者：(美)杜雷特

## 书籍目录

Introductory Lecture  
 1 Laws of Large Numbers 1. Basic Definitions 2. Random Variables 3. Expected Value a. Inequalities b. Integration to the limit c. Computing expected values 4. Independence a. Sufficient conditions for independence b. Independence, distribution, and expectation c. Constructing independent random variables 5. Weak Laws of Large Numbers a. L2 weak laws b. Triangular arrays c. Truncation 6. Borel-Cantelli Lemmas 7. Strong Law of Large Numbers 8. Convergence of Random Series 9. Large Deviations  
 2 Central Limit Theorems 1. The De Moivre-Laplace Theorem 2. Weak Convergence a. Examples b. Theory 3. Characteristic Functions a. Definition, inversion formula b. Weak convergence c. Moments and derivatives d. Poly's criterion e. The moment problem 4. Central Limit Theorems a. i.i.d, sequences b. Triangular arrays c. Prime divisors (Erdős-Kac) d. Rates of convergence (Berry-Esseen) 5. Local Limit Theorems 6. Poisson Convergence a. Basic limit theorem b. Two examples with dependence c. Poisson processes 7. Stable Laws 8. Infinitely Divisible Distributions 9. Limit theorems in  $d \geq 3$   
 Random Walks 1. Stopping Times 2. Recurrence 3. Visits to 0, Arcsine Laws 4. Renewal Theory  
 4 Martingales 1. Conditional Expectation a. Examples b. Properties c. Regular conditional probabilities 2. Martingales, Almost Sure Convergence 3. Examples 236 a. Bounded increments b. Poly's urn scheme c. Radon-Nikodym derivatives d. Branching processes 4. Doob's Inequality,  $L_p$  Convergence Square integrable martingales 5. Uniform Integrability, Convergence in  $L^1$  6. Backwards Martingales 7. Optional Stopping Theorems  
 Markov Chains Ergodic Theorems Brownian Motion  
 Appendix: Measure Theory References Notation Normal Table Index

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>