### <<随机过程导论>>

#### 图书基本信息

书名:<<随机过程导论>>

13位ISBN编号:9787040217780

10位ISBN编号:7040217783

出版时间:2007-6

出版时间:高等教育

作者:陈木法

页数:209

字数:250000

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

### <<随机过程导论>>

#### 内容概要

本书是普通高等教育"十一五"国家级规划教材。 书中集中讲授了马尔可夫链和随机分析,无论从理论还是应用角度看,这两部分都是随机过程理论中 最基本、最重要的内容。

第一部分以遍历性为中心课题,采用一些比较现代的数学工具,单刀直入,从有限状态空间到可数状态空间、从离散时间到连续时间,逐步展开、深入;第二部分包括了鞅、布朗运动和随机微分方程等经典内容,并触及一些现代的研究课题。

本书可作为数学系高年级本科生、数学系和相关的理工科研究生的教材,也可供从事概率论与数理统计专业研究的数学工作者参考。

## <<随机过程导论>>

### 书籍目录

第一1	笆 马	尔可夫过程
-		語散时间马氏链
-		经济最优化的数学模型与马氏链
		离散时间马氏链常返性与遍历性
	-	一般情形下的极限定理
		若干判别准则最小非负解
		几个典型的离散时间马氏链
	•	补充与习题
		连续时间马氏链
	§ 2.1	
		常返性与遍历性
		单生过程与生灭过程
		分支过程与扩展的分支过程
	§ 2.5	补充与习题
第.	三章	可逆马氏链
	§ 3.1	可逆与可配称马氏链
	§ 3.2	谱隙估计
		附录:可逆马氏链的谱表示
	§ 3.4	补充与习题
第	四章	一般马氏过程
		马氏性及其等价形式
	•	强马氏性
		附录:最优停止问题——女秘书问题
		补充与习题
		机分析
_	-	定义及基本性质
		Doob停止定理
		基本不等式
	_	收敛定理
	§ 5.5	连续参数鞅(上、下鞅)
		<b>・ 対象を表して、下級を表現を表現を表現を表現を表現を表現を表現を表現を表現を表現を表現を表現を表現を</b>
쏰.	3 5.7 六辛	补充与习题 布朗运动
		布朗运动
		轨道性质 を紹うされた数性度
		布朗运动的鞅性质
	9 6.4	高维布朗运动
		补充与习题
		如积分与扩散过程
	-	随机积分
		Ito公式
		随机微分方程
		一维扩散过程
	§ 7.5	补充与习题

## <<随机过程导论>>

第	八章	半鞅与随机积分
	§ 8.1	Doob-Meyer分解的唯一性
	§ 8.2	Doob-Meyer分解的存在性
	§ 8.3	变差过程的性质
	§ 8.4	随机积分
	§ 8.5	lto公式
	§ 8.6	局部鞅与半鞅
	§ 8.7	多元随机积分
	§ 8.8	随机微分方程(高维情形)
	§ 8.9	Feynman-Kac公式等三个数学工具
	§ 8.10	补充与习题
后记		
参考	文献	
索引		

# <<随机过程导论>>

编辑推荐

## <<随机过程导论>>

### 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