

<<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：9787115165985

10位ISBN编号：711516598X

出版时间：2007-10

出版单位：人民邮电出版社

作者：卡琳

页数：557

字数：586000

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。

书中主要内容有：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。

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-MeGregor定理即以他的名字命名。

<<随机过程初级教程>>

书籍目录

Chapter 1 ELEMENTS OF STOCHASTIC PROCESSES 1. Review of Basic Terminology and Properties of Random Variables and Distribution Functions 2. Two Simple Examples of Stochastic Processes 3. Classification of General Stochastic Processes 4. Defining a Stochastic Process Elementary Problems Problems Notes References

Chapter 2 MARKOV CHAINS 1. Definitions 2. Examples of Markov Chains 3. Transition Probability Matrices of a Markov Chain 4. Classification of States of a Markov Chain 5. Recurrence 6. Examples of Recurrent Markov Chains 7. More On Recurrence Elementary Problems Problems Notes References

Chapter 3 THE BASIC LIMIT THEOREM OF MARKOV CHAINS AND APPLICATIONS 1. Discrete Renewal Equation 2. Proof of Theorem 1.1 3. Absorption Probabilities 4. Criteria for Recurrence 5. A Queueing Example 6. Another Queueing Model 7. Random Walk Elementary Problems Problems Notes Reference

Chapter 4 CLASSICAL EXAMPLES OF CONTINUOUS TIME MARKOV CHAINS 1. General Pure Birth Processes and Poisson Processes 2. More about Poisson Processes 3. A Counter Model 4. Birth and Death Processes 5. Differential Equations of Birth and Death Processes 6. Examples of Birth and Death Processes 7. Birth and Death Processes with Absorbing States 8. Finite State Continuous Time Markov Chains Elementary Problems Problems Notes References

Chapter 5 RENEWAL PROCESSES Chapter 6 MARTINGALES Chapter 7 BROWNIAN MOTION Chapter 8 BRANCHING PROCESSES Chapter 9 STATIONARY PROCESSES REVIEW OF MATRIX ANALYSIS Index

<<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>