

<<随机过程基础>>

图书基本信息

书名：<<随机过程基础>>

13位ISBN编号：9787561817353

10位ISBN编号：7561817355

出版时间：2003-3

出版时间：天津大学出版社

作者：王家生/刘嘉焜编

页数：199

字数：285000

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>

## <<随机过程基础>>

### 内容概要

本书是为工科院校研究生及本科生学习随机过程而编写的。

内容包括概率论的基本知识、随机过程的基本概念、Markov链、平稳过程和时间序列分析。

本书力求贯彻选材精当而叙述详细的原则，注重说明概念的直观背景和实际意义，在基本理论和方法的阐述上力求通俗易懂、深入浅出，书中收入许多实际问题的典型例子，章末配有习题，有助于读者学习和理解全书的内容。

本书可供工科院校研究生及本科生作为教材，也可供工程技术、管理人员自学参考用。

## &lt;&lt;随机过程基础&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 概率论的基本知识 1.1 概率空间 1.2 随机变量 1.3 随机变量的数字特征 1.4 条件数学期望 1.5 概率论中常用的变换 1.6  $n$ 维正态分布第2章 随机过程的基本概念 2.1 随机过程的定义 2.2 随机过程的数字特征 2.3 几种重要的随机过程 2.4 Poisson过程 习题第3章 Markov链 3.1 Markov链的概念 3.2 状态的分类 3.3 状态空间的分解 3.4 遍历定理与平稳分布 3.5 连续时间的Markov链 3.6 生灭过程 习题第4章 平稳过程 4.1 随机分析 4.2 平稳过程协方差函数的谱分解 4.3 平稳过程的谱分解 4.4 线性系统中的平稳过程 4.5 平稳过程的均方遍历性与采样定理 习题第5章 时间序列分析 5.1 ARMA(p,q)模型 5.2 ARMA(p,q)模型的等价形式 5.3 ARMA序列的相关分析 5.4 模型的初步识别 5.5 模型参数的估计 5.6 模型的定价与检验 5.7 平稳时间序列的预报 5.8 非平稳序列及其预报 习题附录I 定理5.1.1的证明附录II 常系数线性齐次差分方程解法附录III 定理5.3.1的证明附录IV 定理5.3.6的证明附录V 数据的预处理与检验附表1-7参考文献

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>