

<<随机过程>>

图书基本信息

书名：<<随机过程>>

13位ISBN编号：9787562231431

10位ISBN编号：7562231435

出版时间：2008-8

出版时间：华中师范大学出版社

作者：吴群英

页数：183

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>>

### 内容概要

《高等学校教材：随机过程》较为系统地介绍了随机过程的基本概念、基本思想、基本原理和基本方法，主要内容有：概率论补充知识，泊松过程，更新理论，离散时间与连续时间马尔可夫链。

《随机过程》的特点是，在系统介绍随机过程基本理论和方法的同时，强调实际应用，着重讲清各种方法的实际背景和思想方法，注重渗透随机过程的思想，并尽力结合自然科学，特别是经济等领域的实际案例介绍随机过程的实用方法，把随机过程的方法与实际应用结合起来。

书中每一章都给出许多具有启发性的实例，一方面便于读者理解，另一方面也便于读者自学。

<<随机过程>>

作者简介

吴群英，女，博士，教授，从事高教数学教学26年。  
广西壮族自治区优秀专家，广西新世纪十百千人才工程第二层次人选，广西高校百名中青年学科带头人。  
研究领域：概率论与数理统计；研究方向：随机过程和极限理论。  
2000年以来主持国家自然科学基金及省级基金共6项、广西高校自治区级精品课程1门、教改项目1项，获广西科技进步二等奖1项。  
在《数学学报》、《Chinese Journal of Contemporary Mathematics》等刊物发表学术论文56篇，出版专著2部、教材3本。

## &lt;&lt;随机过程&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 基础知识1.1 概率1.1.1 事件序列的上极限和下极限1.1.2 概率的连续性1.2 数学期望与条件数学期望1.2.1 数学期望1.2.2 条件数学期望1.3 矩母函数及特征函数1.4 指数分布的无记忆性1.5 极限定理1.6 随机过程习题第2章 泊松过程2.1 泊松过程2.2 来到间隔与等待时间的分布2.2.1 来到间隔的分布2.2.2 等待时间的分布2.3 剩余寿命与年龄2.4 来到时刻的条件分布2.5 泊松过程的模拟、检验及参数估计2.5.1 模拟2.5.2 检验2.5.3 参数的估计2.6 非齐次(非平稳)泊松过程2.7 复合泊松过程2.8 条件泊松过程习题二第3章 更新理论3.1 引言与定义3.2 更新过程 $N(t)$ 的分布及其性质3.3 若干极限定理3.3.1  $N(t)$ 的极限定理3.3.2 瓦尔德(Wald)等式3.3.3 更新理论3.4 关键更新定理及其应用3.4.1 关键更新定理3.4.2 交错更新过程3.4.3 平均剩余寿命极限与 $m(t)$ 的展开式3.5 延迟更新过程3.6 更新酬劳过程3.7 再生过程习题三第4章 马尔可夫链(Markovchain)4.1 引言与例子4.2 切普曼-柯尔莫哥洛夫(Chapman-Kolmogorov)方程及状态分类4.3 极限定理4.3.1  $P_n$ 的极限性态4.3.2 平稳分布4.4 赌徒输光问题4.5 分支过程4.6 时间可逆的马尔可夫链习题四第5章 连续时间马尔可夫链5.1 定义与若干基本概念5.2 密度矩阵-Q矩阵及其概率意义5.3 柯尔莫哥洛夫向前和向后微分方程5.4 生灭过程5.4.1 生灭过程5.4.2 一些特殊的生灭过程5.5 强马尔可夫性与嵌入马尔可夫链5.6 连续参数马尔可夫链的随机模拟习题五名词索引

<<随机过程>>

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>