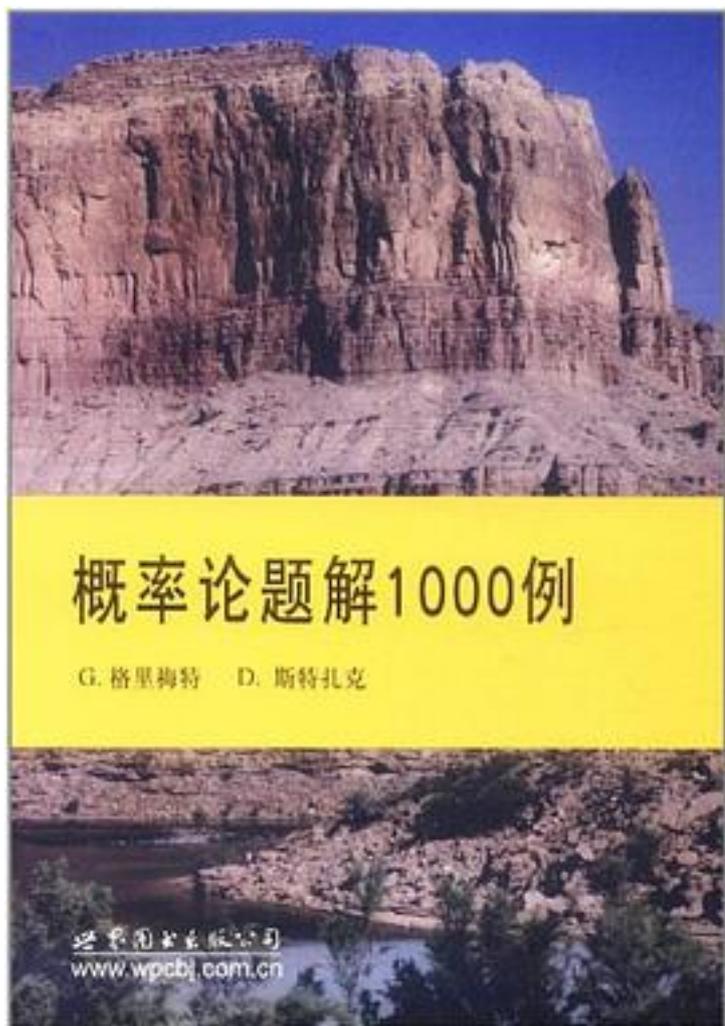


概率论题解1000例



[概率论题解1000例_下载链接1](#)

著者:Geoffrey Grimmett

出版者:世界图书出版公司北京公司

出版时间:2011-12

装帧:平装

isbn:9787510035180

本书是一部概率论和随机过程伴随习题集，堪称是经典中的经典，2002,2003,2004,2005

,2006,2007,2009重印出版, 包含关于概率论和随机过程方面的1000道习题, 涉及样本、Markov链、收敛、平稳过程、更新、序列、鞅、扩散、数学金融和Black-Scholes模型等方面。虽然本书是作者《概率论和随机过程》的辅助读物, 但其内容仍然自成体系, 具有很强的独立性, 是一本学习概率论和随机过程的参考习题集。读者对象: 本书适用于数学专业, 概率统计应用领域的学生, 老师和相关读者。

作者介绍:

目录:

目次: (一) 事件及其概率: 引言; 集合、事件; 概率; 条件概率; 独立性; 完备性和乘积空间; 旧题新问; 习题; (二) 随机变量及其分布: 随机变量; 平均值的分布; 离散型和连续型随机变量; 旧题新问; 随机向量; 蒙特卡洛模拟; 习题; (三) 离散型随机变量: 分布列; 独立性; 期望; 示性函数、匹配问题; 离散型随机变量的例子; 不独立; 条件分布与条件期望; 随机变量之和; 简单随机游动; 随机游动: 样本轨道计数; 习题; (四) 连续型随机变量: 概率密度函数; 独立性; 期望; 连续型随机变量的例子; 不独立; 条件分布与条件期望; 随机变量的函数; 随机变量之和; 高维正态分布; 由正态分布产生的分布; 随机样本的构造; 耦合与泊松逼近; 几何概率模型; 习题; (五) 母函数及其应用: 母函数; 一些应用; 随机游动; 分支过程; 年龄相依的分支过程; 再谈期望; 特征函数; 特征函数举例; 反转定理和连续性定理; 两个极限定理; 大偏差; 习题; (六) 马氏链: 马氏过程; 状态分类; 马氏链分类; 平稳分布和极限定理; 可逆性; 有限状态马氏链; 再谈分支过程; 纯生过程和泊松过程; 连续时间马氏链; 一致半群; 生灭过程和嵌入链; 特殊的过程; 高维泊松过程; 马氏链蒙特卡洛; 习题; (七) 随机变量的收敛: 引言; 几种收敛; 一些辅助结论; 大数定律; 强大数定律; 重对数律; 鞅; 鞅收敛定理; 预测和条件期望; 一致可积; 习题; (八) 随机过程: 引言; 平稳过程; 更新过程; 排队论; 维纳过程; 过程的存在性; 习题; (九) 平稳过程: 引言; 线性预测; 自协方差和谱; 随机积分和谱表示; 遍历定理; 高斯过程; 习题; (十) 更新过程: 更新方程; 极限定理; 余寿; 应用; 更新回报过程; 习题; (十一) 排队论: 单台服务排队系统; M/M/1; M/G/1; G/M/1; G/G/1; 交通繁忙; 排队网络; 习题; (十二) 鞅: 引言; 鞅差和Hoeffding不等式; 上(下)穿和收敛; 停时; 可选停时; 极大不等式; 倒鞅和连续时间鞅; 一些例子; 习题; (十三) 扩散过程: 引言; 布朗运动; 扩散过程; 首达时间; 反射壁; 游弋和布朗桥; 随机微积分; 伊滕积分; 伊滕公式; 期权定价; 穿越概率和位势; 习题。参考文献; 索引。
• • • • • (收起)

[概率论题解1000例_下载链接1](#)

标签

数学

概率

概率论

probability

随机数学

统计

分析

习题集

评论

习题十分有水准，是结合了苏系的深刻与美系的锻炼思维的题目，答案也十分详细，只是实在太多了……以及，断断续续刷了一年终于刷完了 hhh

One Thousand Exercises in Probability.djvu 已下载。

难哭了

习题质量极高

[概率论题解1000例_下载链接1](#)

书评

[概率论题解1000例_下载链接1](#)