

# 随机过程及其应用



[随机过程及其应用\\_下载链接1](#)

著者:陆大紘

出版者:清华大学出版社

出版时间:2006-5

装帧:平装

isbn:9787302001409

《随机过程及其应用》着重讨论了随机过程的基本研究方法，论述了应用广泛的几种基本随机过程，并对其在控制和电子技术中的应用作了相应的介绍。全书共分7章。第1章提出随机过程的两类基本分析方法。第2章、第3章是采用第一类分析方法研究马尔可夫过程和马尔可夫链，对马尔可夫过程着重研究的是参数连续状态离散的马尔可夫过程，对泊松过程作了较详细的讨论，并引出了排队问题。第4章采用第二类分析方法研究二阶矩过程、平稳过程，并着重讨论了随机分析。第5章研究谱分析和线性系统，先用相关函数方法研究初始状态为零的条件下线性系统的响应，然后进一步讨论非零初始情况下线性系统的响应。第6章讨论正态过程。第7章为估值理论，它是随机过程应用的一个方面，也是为学习下一门课程“信号的统计检测和估值”作准备。为了配合理论的学习，在各章后面配有一定数量的习题。

本书可供理工科大学有关专业的教师、研究生和高年级学生作教材或教学参考书，也可供有关工程技术人员自学。

作者介绍:

目录:

[随机过程及其应用\\_下载链接1](#)

## 标签

随机过程

数学

经典

陆大鈺

统计

教材

信号处理

应用数学

## 评论

没有读多少，不过印刷实在太差。

-----  
非常经典，可惜印刷排版太差严重影响阅读

-----  
前面写得不错，后面有点乱。

-----  
比较难懂....

-----  
就这么结束了。。。啥都没学会

-----  
陆老的书 很严谨很经典~ 难得~~

-----  
讲得很细致很清楚

-----  
最近看图模型……突然想在读一遍

-----  
过于冗余

-----  
[随机过程及其应用\\_下载链接1](#)

书评

-----  
[随机过程及其应用\\_下载链接1](#)