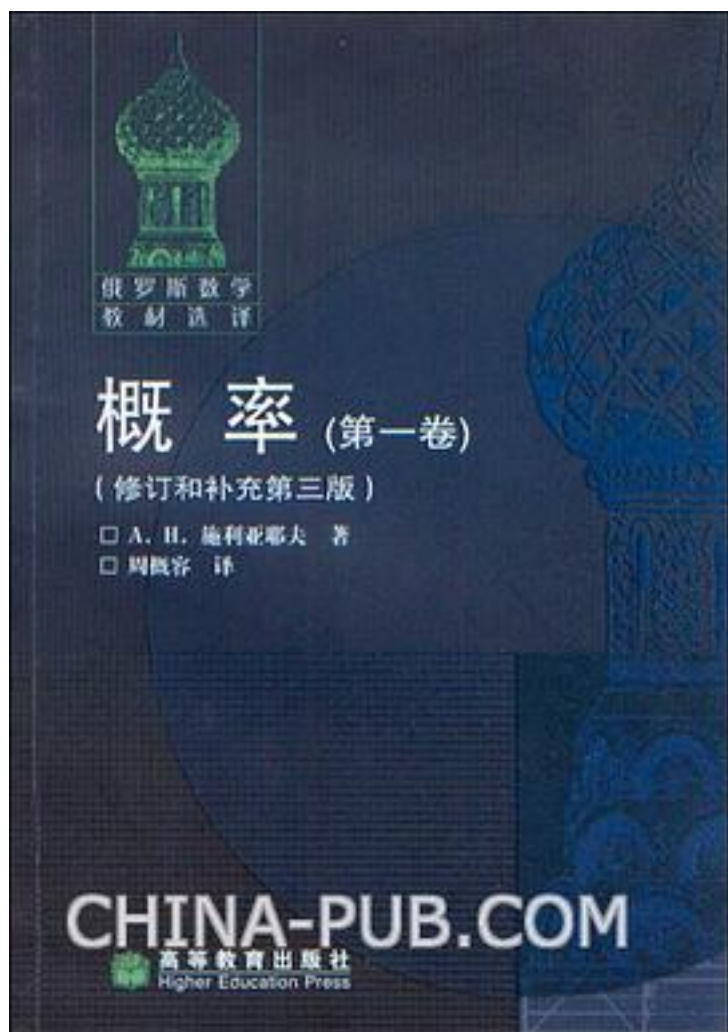


# 概率



[概率\\_下载链接1](#)

著者:[俄]施利亚耶夫

出版者:高等教育出版社

出版时间:2008-1

装帧:

isbn:9787040225556

《概率(第2卷)(修订和补充第3版)》是俄国著名数学家A.H.施利亚耶夫的力作。施利亚耶

夫是现代概率论奠基人、前苏联科学院院士、著名数学家A.H.柯尔莫戈洛夫的学生，在概率统计界和金融数学界影响极大。《概率(第2卷)(修订和补充第3版)》作为莫斯科大学最为出色的概率教材之一。分为一、二两卷，并配有习题集。第二卷《概率(第2卷)(修订和补充第3版)》是离散时间随机过程(随机序列)的内容。重点讲述(强和弱)平稳序列、鞅和马尔可夫链，并给出了随机序列中的估计和过滤问题、随机金融数学、保险理论和最优停时问题等领域的应用。书后附有概率的数学理论形成的简史。在图书文献资料中，指出了所引用结果的出处，并且给出了注释。此外，还列出了相应的补充文献资料。第一卷《概率(第2卷)(修订和补充第3版)》是初等概率论的内容，可以作为初步了解概率论学科的教材。大部分内容涉及以柯尔莫戈洛夫公理化体系为基础的初等概率论、概率论的数学基础、概率测度的收敛性和极限定理等基本问题。

作者介绍:

目录: 前言

第四章 独立随机变量之和与独立随机变量序列

§ 1.0-1律

§ 2.级数的收敛性

§ 3.强大数定律

§ 4.重对数定律

§ 5.强大数定律的收敛速度和大偏差概率

第五章 强(狭义)平稳随机序列和遍历理论

§ 1.强(狭义)平稳随机序列.保测变换

§ 2.遍历性与混合性

§ 3.遍历性定理

第六章 弱(广义)平稳随机序列.L2理论

§ 1.协方差函数的谱表示

§ 2.正交随机测度和随机积分

§ 3.弱(广义)平稳序列的谱表示

54.协方差函数和谱密度的统计估计

§ 5.沃尔德分解

§ 6.外推、内插和过滤

§ 7.卡尔曼-布西滤波器及其推广

第七章 构成鞅的随机变量序列

§ 1.鞅和相关概念的定义

§ 2.在时间变量为随机时间时鞅性的不变性

§ 3.一些基本不等式

§ 4.下鞅和鞅收敛的基本定理

§ 5.下鞅和鞅的收敛集

§ 6.概率测度在带滤子可测空间上的绝对连续性和奇异性

§ 7.随机游动越出曲线边界的概率的渐近式

§ 8.相依随机变量之和的中心极限定理

§ 9.伊藤公式的离散版本

§ 10.保险中破产概率的计算.鞅方法

§ 11.随机金融数学的基本定理.无仲裁的鞅特征

§ 12.无仲裁模型中与“套头交易”有关的核算

§ 13.最优停时问题.鞅方法

第八章 形成马尔可夫链的随机变量序列

§ 1.定义和基本性质

§ 2.推广马尔可夫性和强马尔可夫性

§ 3.马尔可夫链的极限、遍历和平稳概率分布问题

§ 4.马尔可夫链的状态按转移概率矩阵的代数性质分类

§ 5.马尔可夫链的状态按转移概率矩阵的渐近性质分类

§ 6.可数马尔可夫链的极限分布、遍历分布和平稳分布

§ 7.有限马尔可夫链的极限分布、遍历分布和平稳分布

§ 8.作为马尔可夫链的简单随机游动

§ 9.马尔可夫链的最优停时问题

概率的数学理论形成的简史

“概率的数学理论形成的简史”的参考文献

图书文献资料（第四章～第八章）

参考文献

名词索引

人名表

记号索引

常用数学符号

• • • • • [\(收起\)](#)

[概率\\_下载链接1](#)

## 标签

数学

概率

概率论

基础数学

统计

概率统计

科学

Mathematics

## 评论

随机过程

---

翻译水平有待提高。

---

参考

---

有意义

---

考完试慢慢啃

---

[概率\\_下载链接1](#)

## 书评

给了三星的评价不是作者不写得不行，是译者译得不行，翻译错误打印错误太多。能看俄文版的看俄文版的吧，第四版出了。英文版虽然amazon上说第三版出了，等了好久还是没有看到，目前市面上的是英文第二版，入门够用了，和第三版好像差别不算太大。anyway，不要再浪费时间在这书...

---

这是最喜欢的概率课本，作者是Kolmogorov的学生，想也知道会是很好的书。看小米的书多了，发现俄罗斯的数学完全是另外一种风格，比如俄国人眼中的初等概率只涉及离散型随机变量。。。。。。这是一本非常完备的课本，循序渐进讲得非常清楚，虽然出得比较早了，拿来当入门教材真...

---

非常非常好的概率书。我仔细读过Billingsley，翻过Durrett和Dudley，比较下来，还是最喜欢Shiryaev的这本。这本书思路清晰，写法干净简洁。我最喜欢的几点：（1）书中经常有点睛之笔，或精要综述前文，或点出后文所述理论之缘由。这样，对于“我在干什么”和“我为什么要干这些...

-----  
[概率 下载链接1](#)