

目录

1 随机过程的基本概念	2
1.1 随机过程的定义与有穷维分布族	2
1.2 随机过程的分类	2
2 泊松过程	3
2.1 泊松过程的定义	3
2.2 泊松过程的性质	3
2.3 非齐次的泊松过程	3
2.4 复合泊松过程	3
3 离散时间的马尔可夫链	4
3.1 马尔可夫链的基本概念	4
3.2 马氏链的状态分类	4
3.3 转移概率的极限状态与平稳分布	4
4 连续时间的马尔可夫链	5
4.1 连续时间马氏链的基本定义	5
4.2 转移率	5
4.3 Kolmogorov 方程	5
4.4 生灭过程	5
5 布朗运动	6
5.1 布朗运动的定义及基本性质	6
5.2 布朗运动的首中时和最大值	6
5.3 布朗运动的推广	6

1 随机过程的基本概念

1.1 随机过程的定义与有穷维分布族

1.2 随机过程的分类

2 泊松过程

2.1 泊松过程的定义

2.2 泊松过程的性质

2.3 非齐次的泊松过程

2.4 复合泊松过程

3 离散时间的马尔可夫链

3.1 马尔可夫链的基本概念

3.2 马氏链的状态分类

3.3 转移概率的极限状态与平稳分布

4 连续时间的马尔可夫链

4.1 连续时间马氏链的基本定义

4.2 转移率

4.3 *Kolmogorov* 方程

4.4 生灭过程

5 布朗运动

5.1 布朗运动的定义及基本性质

5.2 布朗运动的首中时和最大值

5.3 布朗运动的推广