

大 家 新 学 期 好!

## 第0章 课程简介

个人信息

苏中根

浙江大学数学学院统计系

电话: 13588731705

紫金港校区海纳2号楼812

Email: suzhonggen@zju.edu.cn

<http://course.zju.edu.cn/>

研究兴趣: 概率极限理论及其应用

## 课程信息

随机过程(2023-2024-2)-06191360-0089282-1

授课时间：周四上午3，4，5，地点：紫金港西2-415

作业：每周一次，周四上交

助教：郑惠廉

电话：13894725355，Email: 2493387386@qq.com

平时成绩：点名10分、作业10分、两次随堂测验20分

期终考试成绩：闭卷60分，

考试时间：2024年6月26日下午14:00-16:00

●过程性考核（小测）、期中考试和期末考试：学校多次强调考试纪律的严肃性，如有学生违反学风学纪行为，一经发现，将按学校相关规定严肃处理；

教材：苏中根，随机过程，高等教育出版社, 2020

参考书：

[1] 缪柏其，随机过程，科学出版社

[2] 林元烈，应用随机过程；清华大学出版社，2002

- [3] A.Papoulis, S.U. Pillai, Probability, Random Variables, and Stochastic processes, 机械工业出版社
- [4] E.P.C. Kao, An introduction to Stochastic Processes, China machine press (中国机械出版社)
- [5] S. Karlin, H.M. Taylor, An introduction to Stochastic Modeling, Academic Press
- [6] G. Grimmett, D. Stirzaker, Probability and Random Processes, Cambridge University Press
- [7] Van Kampen, Stochastic processes in physics and chemistry, 世界图书出版公司
- [8] S. Karlin; H.M. Taylor, A first course in stochastic processes, 人民邮电出版社

## 本学期主要内容

- 一、初等概率论
- 二、随机过程基本概念
- 三、Poisson 过程
- 四、Markov 链
- 五、Galton-Watson分枝过程
- 六、Brown 运动
- 七、平稳过程遍历性
- 八、复习

