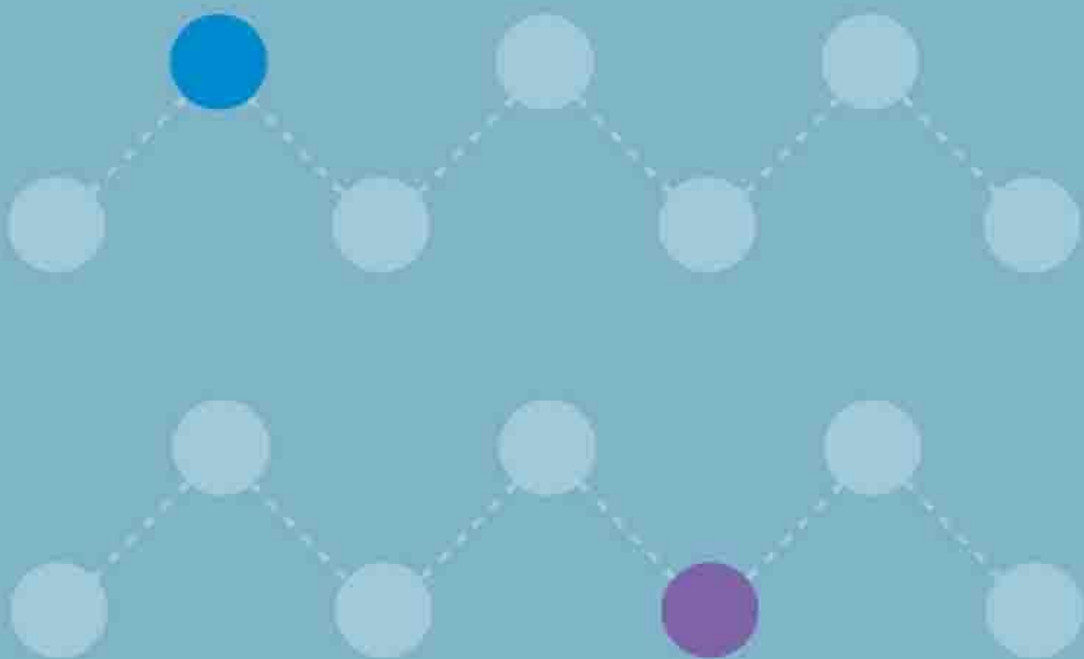




随机引论

吴昭景 编著



 科学出版社

内 容 简 介

本书共分5章.第1章为测度论基础,讲解可测空间、测度空间、可测函数、积分和乘积空间.第2章为概率论基础,包括数学期望、条件期望、乘积空间的概率测度和独立随机变量序列.第3章为随机过程,首先讲解随机过程的构造和性质,然后是研究随机过程的重要工具:停时与鞅论,最后是介绍若干重要随机过程.第4章为随机微分方程,包括Itô积分的定义与性质,随机微分方程解的存在性和唯一性及平凡解的稳定性理论.第5章为随机系统的建模与模拟,首先介绍了平稳过程的定义,然后基于平稳过程的谱分析,给出了从白噪声到随机微分方程的建模与仿真过程.

本书可作为讲授概率论与随机过程的研究生教材,也可作为高等院校控制理论及其他相近专业研究生的参考书.

图书在版编目(CIP)数据

随机引论/吴昭景编著. —北京:科学出版社,2015

ISBN 978-7-03-044910-8

I. ①随… II. ①吴… III. ①随机-研究 IV. ①O211

中国版本图书馆CIP数据核字(2015)第125334号

责任编辑:石悦李萍/责任校对:胡小洁
责任印制:徐晓晨/封面设计:华路天然工作室

科学出版社出版

北京东黄城根北街16号

邮政编码:100717

<http://www.sciencep.com>

北京京华虎豹印刷有限公司印刷

科学出版社发行 各地新华书店经销

2015年9月第一版 开本:720×1000 B5

2015年3月第三次印刷 印张:15 1/2

字数:302 000

定价:45.00元

(如有印装质量问题,我社负责调换)