

《应用随机过程》教学大纲 2021

共同使用版本

一、 课程简介

二、 教学目标

三 教学内容

第一章 随机过程的概率论基础

要求学生：

第二章 随机过程的基本概念和基本类型

要求学生：

第三章 布朗运动

要求学生：

第四章 泊松过程

要求学生：

第五章 鞅过程及其应用

要求学生：

第六章 马尔科夫链 Markov Chain

要求学生：

第七章 随机积分及其应用

要求学生：

本课程教学周为 16 周，具体安排如下：

五 学习效果及达成途径

学习效果

2. 达成学习效果的途径

六 课程学习资料