

## 課程大綱及進度表

開課系所	應用數學研究所
開課學年	99
開課學期	2
課程名稱(中文)	隨機過程
課程名稱(英文)	Stochastic Processes
課程碼	L155600
分班碼	
先修科目或先備能力	大學機率導論
學分數	3
開課教師	李春得
e-mail	<a href="mailto:T14116@mail.ncku.edu.tw">T14116@mail.ncku.edu.tw</a>
電話	65151
Office Hours	9:00-12:00(四)
課程概述	隨機過程理論之導論
教學目標	引導學生了解隨機過程之理論與應用。
授課課程大綱明細	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 機率與隨機過程之簡介</li> <li>2. Bernoulli 過程及其應用</li> <li>3. Poisson 過程及其應用</li> <li>4. Markov 鏈及其應用</li> <li>5. Markov 過程</li> <li>6. 更新理論及更新過程</li> </ol>
參考書目	Introduction to Stochastic Processes, by E. Cinlar.
課程要求	按時上下課並遵守課堂規則。

評量方式	1. 兩次期中考各佔 30% 2. 一次期末考佔 40%
課程網址	
助教資訊	
備註	