

確率論 (応用数理特論 B ; 数学科 4 年大学院共通)  
 2004 年度後期木曜 2 限 (10:30–12:00)  
 青葉キャンパス合同棟 (総合棟) 801  
 服部哲弥 2004/10/01

講義予定表 (節番号は講義ノートの該当節)

日	節	内容
10/7 10/14	§1	イントロ, 測度, 確率空間・確率変数・期待値の定義と簡単な性質
10/21 10/28 11/4	§2	基本不等式, 確率変数の種々の収束の定義, 特性関数と弱収束
11/11	§3.2	独立性
11/18	§3.2	独立性
11/25	§3.3.1	大数の法則
12/2	§3.3.3	中心極限定理
12/9		試験
12/16	補遺	random walk, 離散 martingale, Brown 運動の中から何か
12/23		予備
1/13	補遺	random walk, 離散 martingale, Brown 運動の中から何か
1/20	補遺	random walk, 離散 martingale, Brown 運動の中から何か

教科書 . URL: <http://www.math.tohoku.ac.jp/hattori/hattori.htm> の下の / 講義 / 確率論 に貼ってある講義ノート, 過去問 .

参考書 . 最近日本語の確率論の (数学的にきちんとした) 基礎教科書が増えてきた . たとえば ,

熊谷 隆, 確率論, 共立出版 (新しい解析学の流れ), 2003 .

伝統的に定評のあるものとしては ,

西尾 真紀子, 確率論, 実教出版, 1978 .

この講義の水準ではどちらでも (あるいは同等の他の教科書でも) 差し支えない .

試験 . 講義録の §3 までに対応する講義, 講義録, 演習問題集, 過去問, を理解することを基本とする .

連絡先 . 服部哲弥 [hattori@math.tohoku.ac.jp](mailto:hattori@math.tohoku.ac.jp) (数学棟 512)