

電気通信大学 平成16年度シラバス

授業科目名	応用確率解析		
英文授業科目名	Applied Analytics of Probability		
開講年度	2004年度	開講年次	3年次
開講学期	6学期	開講コース・課程	昼間コース
授業の方法		単位数	2
科目区分	専門科目-専門共通科目-選択科目		
開講学科・専攻	システム工学科		
担当教官名	吉田 稔		
居室	西5-607		

公開E-Mail	授業関連Webページ
yoshida@se.uec.ac.jp	

<b>【主題および達成目標】</b>
<p>主題： 離散マルチンゲールと確率積分の基礎</p> <p>達成目標： 測度論に基づいて確率論が構成されていることを、大まかに理解し、確率変数、確率過程を可測関数として捕らえられるようにする。確率微分方程式が常微分方程式の自然な確率的拡張であることを理解する。</p>

<b>【前もって履修しておくべき科目】</b>
微分積分学第一、二； 線形代数学第一、二、システム数理基礎B

<b>【前もって履修しておくことが望ましい科目】</b>
数学関連の科目総て。

<b>【教科書等】</b>
指定なし

<b>【授業内容とその進め方】</b>
<p>授業内容については、主題および達成目標を参照のこと。</p> <p>演習を行わない代わりに、必ず毎回課題を課します、この課題をしっかりとこなす事により、初め講義の理解が可能となります。</p>

## 電気通信大学 平成16年度シラバス

--

### 【成績評価方法及び評価基準(最低達成基準を含む)】

毎回提出されたレポート、及び期末試験にて評価します。  
特に、レポートの比重は80%以上であることに留意されよ。

### 【オフィスアワー：授業相談】

適宜相談に応じます。

### 【学生へのメッセージ】

卒業研究で数学を多用する分野（例えば、最適制御、生体システム、信頼性工学、数理ファイナンス 等）に進む気持ちのある人には重要な”数学”です。  
何に活用できるかも含めできるだけ解りやすく説明しますが、レポート提出も毎回要求し、厳しい評価をします。  
本気で取り組む人のみが、単位を取得できます。

### 【その他】

--