

# 統計数学II 第15回

担当：三角 淳 2013年7月23日

## 講義概要

- ・ 連続時間マルコフ連鎖の推移確率の計算例。
- ・ ブラウン運動など、発展的話題の紹介。

## 期末試験の予告問題 (数値は変える予定です)

[1]  $\{N_t\}_{t \geq 0}$  をパラメーター  $\lambda > 0$  のポアソン過程とし、 $S_n = \inf\{t \geq 0 \mid N_t = n\}$  とする。

- (1)  $N_5$  と  $N_6$  が独立でない事を示せ。
- (2)  $S_2$  と  $S_4$  が独立でない事を示せ。