



# UNIVERSITÀ DI PISA

---

## PROBABILITÀ

**DARIO TREVISAN**

Anno accademico 2019/20  
CdS MATEMATICA  
Codice 070AA  
CFU 6

Moduli	Settore/i	Tipo	Ore	Docente/i
PROBABILITÀ	MAT/06	LEZIONI	60	MAURIZIA ROSSI DARIO TREVISAN

### Obiettivi di apprendimento

#### *Conoscenze*

Risultati principali di teoria della misura; proprietà delle successioni di variabili aleatorie indipendenti; primi elementi sui processi stocastici.

#### *Modalità di verifica delle conoscenze*

Prova orale su teoria ed esercizi.

#### *Capacità*

Comprensione della Probabilità e capacità di ragionamento sugli oggetti del corso.

#### *Modalità di verifica delle capacità*

Ragionamento su vari elementi del corso, in sede d'orale, capacità di riprodurre enunciati, dimostrazioni e risolvere esercizi

#### *Comportamenti*

Lo studente potrà acquisire capacità di ragionamento autonomo su metodologie matematiche per fenomeni aleatori.

#### *Modalità di verifica dei comportamenti*

In sede di orale si richiede buona capacità di ragionamento autonomo, oltre che la riproposizione di elementi appresi.

#### *Prerequisiti (conoscenze iniziali)*

Gli insegnamenti di analisi e di algebra lineare del biennio, il corso "Elementi di Probabilità e Statistica"

#### *Indicazioni metodologiche*

Esame ragionato delle dispense del corso e degli esercizi proposti durante lo svolgimento del corso.

#### *Programma (contenuti dell'insegnamento)*

Costruzione di una probabilità e dell'integrale rispetto a una probabilità.  
Indipendenza di variabili aleatorie, lemmi di Borel-Cantelli e Legge 0-1 di Kolmogorov.  
Convergenza di variabili aleatorie e convergenza di Probabilità: criterio di Prohorov.  
Le funzioni caratteristiche e legame con la convergenza in Legge.  
Teoremi limite: Leggi dei Grandi Numeri e Teoremi Limite Centrale.  
Speranza condizionale e sue proprietà  
Primi rudimenti di teoria dei Processi Stocastici: il processo di Wiener ed il processo di Poisson.

#### *Bibliografia e materiale didattico*

Dispense del corso e fogli di esercizi.

#### *Modalità d'esame*



# UNIVERSITÀ DI PISA

---

Prova orale.

Pagina web del corso

<http://people.dm.unipi.it/trevisan/didattica.html>

*Ultimo aggiornamento 05/09/2019 10:29*