

# 統計数学II 第5回

担当：三角 淳 2012年11月6日

## 講義概要

- ・条件付期待値の計算：確率変数  $X$  と、 $P(A) > 0$  をみたす事象  $A$  に対して

$$E(X|A) = \frac{E(X1_A)}{P(A)}.$$

ここで  $1_A$  は事象  $A$  が起こったときに値 1 をとり、起こらなかったときに値 0 をとるような確率変数である。

- ・計算例 1： $\{N_t\}_{t \geq 0}$  がパラメータ  $\lambda > 0$  のポアソン過程のとき

$$E(N_t N_s) = \lambda s(\lambda t + 1) \quad (0 < s < t)$$

- ・計算例 2：上の  $\{N_t\}_{t \geq 0}$  に対して

$$E(N_t | N_s = k) = \lambda(t - s) + k \quad (0 < s < t, k = 0, 1, 2, \dots)$$

レポート問題 以下の [1] の解答を、次回の授業のはじめに提出して下さい。(授業に関する要望・質問等があれば、レポートの余白に記入して下さい。)

- [1]  $\{N_t\}_{t \geq 0}$  がパラメータ 1 のポアソン過程のとき、 $E(N_4 N_3 | N_2 = 0)$  を求めよ。

## 補充問題

- [2] 離散型確率変数  $X$  を  $P(X = k) = \frac{1}{3} (k = 1, 2, 3)$  であるようなものとする。このとき、 $E(X | X \geq 2)$  を次の 2 通りの方法で求めよ。

(1)  $\frac{E(X1_{\{X \geq 2\}})}{P(X \geq 2)}$  を計算する。

(2)  $\sum_k k P(X = k | X \geq 2)$  を計算する。

- [3]  $\{N_t\}_{t \geq 0}$  がパラメータ 2 のポアソン過程のとき次を求めよ。

(1)  $E(N_1^2 N_4)$ , (2)  $E(N_3^2 | N_1 = 1)$ .