

Τρίτο Φυλλάδιο Εργασίας Στοχαστικές Διαδικασίες (ΠΜΣ)

Τμήμα Στατιστικής και Αναλογιστικών - Χρηματοοικονομικών
Μαθηματικών

Πανεπιστήμιο Αιγαίου

Διδάσκων: Νίκος Χαλιδιάς

- (1) Υπολογίστε τη χαρακτηριστική συνάρτηση μιας τυχαίας μεταβλητής η οποία ακολουθεί την εκθετική κατανομή παραμέτρου λ . Χρησιμοποιώντας τη χαρακτηριστική συνάρτηση υπολογίστε τη μέση τιμή και την διακύμανσή της.
- (2) Αποδείξτε την άσκηση 407, το θεώρημα 411, την πρόταση 413, το θεώρημα 427, το θεώρημα 438 και το θεώρημα 443.
- (3) Μελετήστε το παράδειγμα 454 λεπτομερώς και υπολογίστε τις οριακές πιθανότητες χρησιμοποιώντας μαθηματικό λογισμικό.