



UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

COURSE SYLLABUS

Applied Probability

2425-1-F8204B004-F8204B006M

Obiettivi formativi

Il corso di Probabilità applicata intende fornire agli studenti gli strumenti della Probabilità necessari a comprendere la Statistica (teorica ed applicata) e l'Economia.

Contenuti sintetici

Dopo un'introduzione alle diverse definizioni di probabilità, verranno presentate le basi della teoria assiomatica di Kolmogorov su cui si poggia la probabilità moderna. Verranno analizzate le proprietà elementari della probabilità, tra cui la continuità, sub-additività, monotonia, inoltre verranno presentati i Lemmi di Borel-Cantelli.

Ampio spazio verrà dato ai vettori aleatori negli spazi euclidei n -dimensionali ed alle trasformazioni di vettori aleatori. Il concetto di valore atteso condizionato sarà definito ed analizzato in dettaglio, con qualche cenno alla teoria della misura.

Nella seconda parte del corso, verranno studiati i quattro concetti di convergenza di variabili aleatorie: in distribuzione, in probabilità, quasi certa e in media r -esima. Saranno quindi presentati e dimostrati i teoremi limite del calcolo delle probabilità e le loro conseguenze.

Infine saranno definiti ed analizzati i vettori Gaussiani attraverso la funzione caratteristica.

Il corso sarà affiancato da molti esercizi pratici.

Programma esteso

1. **INTRODUZIONE.** Cenni storici al calcolo delle probabilità: i problemi classici. Definizioni della probabilità: classica, soggettiva e frequentista. Il principio di coerenza di Bruno de Finetti e le sue conseguenze. L'assiomatizzazione della probabilità di Kolmogorov.
2. **ASSIMI DELLA PROBABILITA' E CONSEGUENZE.** La definizione assiomatica di probabilità. Le

implicazioni della definizione: additività, monotonia, disuguaglianza di Boole, continuità della probabilità. I lemmi di Borel-Cantelli. Le probabilità condizionate e l'indipendenza di eventi.

3. **VARIABILI ALEATORIE E VETTORI ALEATORI.** Definizione di variabile aleatorie e vettore aleatorio (discreti e continui). Il concetto di distribuzione e la funzione di ripartizione. Relazioni tra variabili aleatorie: condizionamento ed indipendenza. Trasformazioni di vettori aleatori: il teorema del diffeomorfismo.
4. **VALORI ATTESI.** Richiami su speranza matematica, varianza e covarianza. La disuguaglianza di Markov. Valore atteso condizionato e sue proprietà.
5. **CENNI DI TEORIA DELLA MISURA.** La probabilità come misura. Le variabili aleatorie nella teoria della misura. L'integrale alla Lebesgue ed il lavoro atteso. Definizione generale di valore atteso condizionato data una sigma-algebra (cenni).
6. **CONVERGENZA DI VARIABILI ALEATORIE.** La convergenza delle variabili aleatorie: in distribuzione, in probabilità, in media r -esima e quasi certa. Le relazioni tra le diverse convergenze. Legge debole dei grandi numeri, cenni alla legge forte di Kolmogorov.
7. **FUNZIONI GENERATRICI.** Funzione caratteristica e generatrice dei momenti. Il teorema di continuità di Lévy. Il teorema centrale di convergenza. Il metodo delta.
8. **VETTORI GAUSSIANI.** Funzione caratteristica per vettori. I vettori Gaussiani.

Prerequisiti

Per affrontare il corso sono necessarie le conoscenze dei corsi di Analisi Matematica (I e II) e del Corso di Calcolo delle Probabilità della laurea triennale.

Metodi didattici

Lezioni frontali e numerosi esercizi. Le lezioni sono di carattere tradizionale e si svolgeranno in presenza in modalità erogativa.

Modalità di verifica dell'apprendimento

L'esame è costituito da una prova scritta, l'orale è facoltativo. La prova scritta è costituita da esercizi e da alcune domande di teoria. Gli esercizi mirano ad accertare la comprensione degli argomenti trattati e la capacità dello studente di applicare i concetti della probabilità. Le domande di teoria servono a verificare la conoscenza e la comprensione dei concetti della probabilità. Le domande di teoria possono riguardare anche dimostrazioni svolte durante il corso.

L'orale è facoltativo e può essere chiesto sia dallo studente che dal docente. L'esame orale verte su tutto il programma del corso e deve essere svolto pochi giorni dopo lo scritto, in base alle disponibilità del docente. In tal caso il voto finale è una media della prova scritta e della prova orale.

Durante lo scritto è consentito l'uso della calcolatrice scientifica, ma non è ammesso l'uso di appunti, libri e strumenti tecnologici.

Testi di riferimento

Testo consigliato (con esercizi):

- G. Dall'Aglio (2003). Calcolo delle Probabilità. Zanichelli, terza edizione.

Testi di consultazione:

- Grimmett G. and Stirzaker D. (2001). Probability and random processes. Oxford University Press.

Eserciziari:

- Epifani, I. e Ladelli, L. (2021). Esercizi di probabilità per l'ingegneria, le scienze e l'economia. Edizioni La Dotta.
- Grimmett G. and Stirzaker D. (2000). One Thousand Exercises in Probability: Third Edition. Oxford University Press.

Periodo di erogazione dell'insegnamento

Primo semestre, primo ciclo.

Lingua di insegnamento

Italiano.

Sustainable Development Goals

ISTRUZIONE DI QUALITÀ
