测度论与概率论基础

严加安 院士

中国科学院数学与系统科学研究院

课程安排：

第一讲：单调类定理（集合形式）, 测度扩张定理

第二讲：单调类定理（函数形式）, 可测函数序列的收敛性

第三讲：积分, 不定积分与符号测度, L^p 空间及其对偶

第四讲：乘积测度, 测度的收敛

第五讲：概率论基础（独立性, 条件数学期望, 随机变量族的一致可积性）

教材：严加安, 测度论讲义（第二版）, 科学出版社

授课时间：

2019 年 7 月 8 日至 7 月 12 日 14:00 — 17:00

授课地点：

数学与统计学院 104 室

报告人简介：

严加安院士主要从事随机分析和金融数学理论的研究工作，在概率论、鞅论、随机分析和白噪声分析领域取得了重要研究成果。曾获国家自然科学奖二等奖，何梁何利基金科学与技术进步奖和华罗庚数学奖。应邀在第 24 届国际数学家大会作 45 分钟报告。