

ПРИМЕРНАЯ ПРОГРАММА КУРСА
«ТЕОРИЯ ВЕРОЯТНОСТЕЙ (ПРОДОЛЖЕНИЕ)»
ЛЕКТОР С.В.ШАПОШНИКОВ

- (1) Условное математическое ожидание и условные вероятности.
- (2) Мартингалы: неравенства и теоремы о сходимости.
- (3) Гауссовские меры: ковариационный оператор и пространство Камерона–Мартина.
- (4) Мера Винера и винеровский процесс. Свойства траекторий.
- (5) Слабая сходимость вероятностных мер. Теорема Александрова. Теорема Прохорова.
- (6) Задача Канторовича оптимальной транспортировки.
- (7) Геометрия пространства вероятностных мер с метрикой Канторовича.
- (8) Дифференциальное исчисление на пространстве вероятностных мер.