

入学年度	学部	学 科	組	番 号	検	フリガナ	
		B	1			氏 名	

1 確率変数 X の取り得る値は x_1, x_2, \dots, x_n であり, それぞれの値をとる確率は p_1, p_2, \dots, p_n であるとする. このとき, 期待値 $E(X)$ は $E(X) = \sum_{k=1}^n x_k p_k$ で定義されるのであった.

a, b を定数とすると, 確率変数 Y を $Y = (aX + b)^2$ と定義する. Y は下のような確率分布をもつ確率変数である.

Y	$(ax_1 + b)^2$	$(ax_2 + b)^2$	\dots	$(ax_k + b)^2$	\dots	$(ax_n + b)^2$	計
P	p_1	p_2	\dots	p_k	\dots	p_n	1

a) Y の期待値 $E(Y)$ を $E(X), E(X^2), a, b$ を用いて表せ.

b) X の分散の定義は $\mu = E(X)$ として, $V(X) = E((X - \mu)^2)$ と表すことができる. b) の結果を用いて $V(X) = E(X^2) - E(X)^2$ が成り立つことを証明せよ.

2 a) 初項 a , 公比 r の等比級数の第 n 項までの和は, $r \neq 1$ のとき,

$$\sum_{k=0}^n ar^k = a + ar + ar^2 + ar^3 + \dots + ar^k + \dots + ar^{n-1} = \frac{a(1 - r^n)}{1 - r} \quad (*)$$

で求まる. いま, $S_n = \sum_{k=0}^n akr^{k-1} = a + 2ar + 3ar^2 + \dots + kar^{k-1} + \dots + nar^{n-1}$ とおくと, $S_n - rS_n$ を計算し, (*) 式を用いて S_n を求めよ. さらに, $|r| < 1$ のとき, $\lim_{n \rightarrow \infty} S_n$ を求めよ.

b) 同様にして, $T_n = \sum_{k=1}^n ak^2r^{k-1} = a + 2^2ar + 3^2ar^2 + \dots + k^2ar^{k-1} + \dots + n^2ar^{n-1}$ とおく. このとき, $T_n - rT_n - 2S_n$ を計算することにより T_n を求めよ. さらに, $|r| < 1$ のとき, $\lim_{n \rightarrow \infty} T_n$ を求めよ.

3 「確率 p で成功，確率 $q = 1 - p$ で失敗」という試行を何回も繰り返すとき，最初に成功するまでの試行回数を X とする．すなわち，確率変数 X は

X	1	2	3	...	k	...	計
P	p	pq	pq^2	...	pq^{k-1}	...	1

という確率分布を持つとする．

a) X の期待値 $E(X)$ を求めよ．

b) X の分散 $V(X)$ を，公式 $V(X) = E(X^2) - E(X)^2$ を用いて求めよ．

4 ある打者は，1 回の打席でヒットを打つ確率が 3 割であるとする．

a) 【復習】この打者が 10 回打席に入ったとき，ヒットを打つ回数の期待値と分散を求めよ．

b) この打者がはじめてヒットを打つまでに必要な打数の期待値と分散を求めよ．

5 【分数関数の微分ができる学生用】

a) 初項 a ，公比 x の無限等比級数は $|x| < 1$ のとき収束し，その和は

$$a + ax + ax^2 + ax^3 + \cdots + ax^k + \cdots = \frac{a}{1 - x}$$

となる．この両辺を x で微分し， x をかけることにより次の式を示せ．

$$ax + 2ax^2 + 3ax^3 + \cdots + kax^k + \cdots = \frac{ax}{(1 - x)^2}$$

b) 同様にして， $ax + 2^2ax^2 + 3^2ax^3 + \cdots + k^2ax^k + \cdots$ を求めよ．

[ヒント：a) の式の両辺を微分し， x をかけよ．]