

Chaînes de Markov : cours et exercices corrigés

Type de contenu : Texte

Type de médiation : sans médiation

Titre(s) : Chaînes de Markov : cours et exercices corrigés / Graham, Carl

Auteur(s) : Graham, Carl

Editeur, producteur : Paris : Dunod, impr. 2008
(impr. en Belgique)

Description matérielle : X-274 p. ; 24 cm

Collection : Sciences sup Mathématiques appliquées pour le master-SMAI master, écoles d'ingénieurs

ISBN : 978-2-10-052083-1

EAN : 9782100520831

Appartient à la collection : Sciences sup. Mathématiques appliquées pour le master-SMAI 1952-2835
2008
Sciences sup 1636-2217 2008

Classification décimale Dewey : 519.233 23

Note sur les bibliographies et les index : Index
Bibliogr. p. 269

Résumé ou extrait : Sommaire : Premières propriétés des chaînes de Markov. Dualité naturelle et approche algébrique. La propriété de Markov et ses extensions. Etude des temps et lieux d'atteinte. Les trajectoires et l'espace d'états. Mesures invariantes et récurrence. Régénération des trajectoires et convergences. Comportement des lois instantanées. Etude du taux de convergence des lois. Méthodes de Monte-Carlo : résolution des problèmes de Dirichlet, simulation de lois invariantes.

Sujet(s) : analyse mathématique
Markov, processus de

Sujet - Nom commun : Markov, Processus de