

Cours de probabilités

Type de contenu : Texte

Type de médiation : sans médiation

Titre(s) : Cours de probabilités [Texte imprimé] / Metivier, M. ; Neveu, J.

Auteur(s) : Métivier, Michel

Editeur, producteur : Palaiseau : École Polytechnique, 1983

Description matérielle : 30 cm

ISBN : 2-7302-0042-8

Note sur les bibliographies et les index : Bibliogr.
Index

Résumé ou extrait : Ce cours de probabilités se déroule en cinq parties : - Le premier est entièrement consacré à l'exposé progressif des concepts d'expérience aléatoire, de variable aléatoire, d'indépendance et de conditionnement. - Le deuxième chapitre étudie les moments des variables aléatoires. Le problème de la corrélation linéaire en fin de chapitre illustre l'intérêt de considérer des espaces normés de variables aléatoires. - Le chapitre III est consacré aux familles de variables indépendantes. En liaison avec cette étude très classique on traite de la transformée de Fourier des mesures bornées sur $\mathbb{R}^d$. Dans ce chapitre on trouve les deux théorèmes fondamentaux : loi des grands nombres et théorème central-limite. - Les relations de dépendance entre variables aléatoires s'expriment naturellement au moyen de la notion d'espérance conditionnelle. Les auteurs ont choisi d'exposer cette notion au chapitre IV, progressivement à partir de la notion élémentaire de conditionnement présentée au chapitre I. - Le dernier chapitre ne prétend ni être un cours de statistique ni un cours de modèles. Les auteurs veulent seulement y donner une idée de quelques problèmes généraux d'identification ou de décision qui se posent à l'utilisateur.

Sujet(s) : probabilités : mathématiques