

Simulation stochastique et méthodes de Monte-Carlo

Type de contenu : Texte

Type de médiation : sans médiation

Titre(s) : Simulation stochastique et méthodes de Monte-Carlo [texte imprimé] / Carl Graham et Denis Talay

Auteur(s) : Graham, Carl

Autre(s) auteur(s) : Talay, Denis

Editeur, producteur : Palaiseau : les Éd. de l'École polytechnique, impr. 2011 (91-Palaiseau; Impr. Centre Poly-média)

Description matérielle : VI-198 p. ; 24 cm

ISBN : 978-2-7302-1582-4

EAN : 9782730215824

Classification décimale Dewey : 519.23 23

Note sur les bibliographies et les index : Bibliogr. p. 197-198

Résumé ou extrait : Ce cours introduit des méthodes probabilistes effectives de calcul et de simulation. Un souci permanent est leur validation et leur illustration dans les situations concrètes, tirées notamment de l'ingénierie financière, l'écologie évolutive et les réseaux de communication. Ces méthodes ont pris une importance déterminante dans des domaines applicatifs stratégiques variés.

Sujet(s) : Markov, processus de

Sujet - Nom commun : Analyse stochastique
Monte-Carlo, Méthode de
Simulation, Méthodes de