

Martingales et chaînes de Markov : théorie élémentaire et exercices corrigés

Type de contenu : Texte

Titre(s) : Martingales et chaînes de Markov : théorie élémentaire et exercices corrigés / Baldi, Paolo ; Mazliak, Laurent ; Priouret, Pierre

Autre(s) auteur(s) : Mazliak, Laurent
Priouret, Pierre

Mention d'édition : Nouv. éd. revue et augm.

Editeur, producteur : Paris : Hermann, 2008

Description matérielle : VI-222 p. ; 21 cm

Collection : Méthodes

Appartient à la collection : Méthodes

Note sur les bibliographies et les index : Bibliogr., 1 p.

Note sur le contenu : Manuel

Résumé ou extrait : L'objectif de cet ouvrage est d'initier à la théorie des martingales et des chaînes de Markov par la pratique d'exercices. Chaque chapitre (espérances conditionnelles, processus aléatoires, martingales, chaînes de Markov) commence par un exposé concis mais complet des principaux résultats. Tous les exercices et les problèmes sont corrigés de façon détaillée.

Sujet(s) : Markov, processus de
martingale (mathématiques)
mathématiques : discipline