

Processus stochastiques : processus de Poisson, chaînes de Markov et martingales : cours et exercices corrigés

Type de contenu : Texte

Titre(s) : Processus stochastiques : processus de Poisson, chaînes de Markov et martingales : cours et exercices corrigés / Foata, Dominique ; Fuchs, Aimé

Autre(s) auteur(s) : Fuchs, Aimé

Editeur, producteur : Paris : Dunod, 2006

Description matérielle : XIII-236 p. ; 24 cm

Collection : Sciences Sup Mathématiques

ISBN : 2-10-048850-3

Appartient à la collection : Sciences Sup

Note sur les bibliographies et les index : Index

Note sur le contenu : Manuel

Résumé ou extrait : Sommaire : Notations utilisées et rappels. Temps d'arrêt. Processus de Poisson. Applications des processus de Poisson. Chaînes de Markov. Applications des chaînes de Markov. Martingales. Théorèmes d'arrêt. Problèmes de ruine. Les inégalités maximales. Théorèmes et convergences des martingales. Exemples d'applications. Le mouvement brownien.

Sujet(s) : Markov, processus de
analyse mathématique
martingale (mathématiques)
mathématiques : discipline
probabilités : mathématiques
théorème