



# Probabilités et processus stochastiques

- Author : Yves Caumel
- Publisher : Springer Science & Business Media, 2011
- pages : 315 pages
- N° Class : 510/60

Ce livre a pour objectif de fournir au lecteur les bases théoriques nécessaires à la maîtrise des concepts et des méthodes utilisées en théorie des probabilités. Après un exposé introductif à la théorie probabiliste dont les liens avec l'analyse fonctionnelle et harmonique sont soulignés, l'auteur présente en détail une sélection de processus aléatoires classiques de type markoviens à temps entiers et continus, poissoniens, stationnaires, etc., et leurs diverses applications dans des contextes tels que le traitement du signal, la gestion des stocks, la modélisation des files d'attente, et d'autres encore. Le livre se conclue par une présentation détaillée du mouvement brownien et par une brève introduction aux équations différentielles stochastiques. Cent soixante exercices (pour la plupart corrigés), ainsi qu'un ensemble de notules historiques ou épistémologiques viennent compléter cet ouvrage.