



# Processus stochastiques: Processus de poisson, chaînes de Markov et martingales

- Author : Dominique Foata
- Publisher : Dunod, 2004
- pages : 236 pages
- N° Class : 510/75

Ce livre s'adresse aux étudiants en 2<sup>e</sup> cycle/Master de mathématiques appliquées et d'informatique, ainsi qu'aux élèves des grandes écoles d'ingénieurs, qui s'orientent vers la recherche opérationnelle. Il présuppose la connaissance d'un cours de probabilités de base, comme celui qui est exposé dans le livre Calcul des probabilités, écrit par les même auteurs. On y trouve un exposé sur les processus de Poisson, les chaînes de Markov et les martingales à temps discret, ainsi qu'une brève introduction au mouvement brownien. Le livre comporte de nombreux exercices, dont la solution est généralement détaillée et un chapitre d'exemples d'applications, dans lesquels les différents processus sont utilisés.