

UE Probabilités



Niveau d'étude
Bac +4



ECTS
9 crédits



Crédits ECTS
Echange
9.0



Composante
UFR IM2AG
(informatique,
mathématiques
et
mathématiques
appliquées)



Période de
l'année
Automne (sept.
à dec./janv.)

- > **Langue(s) d'enseignement:** Français
- > **Ouvert aux étudiants en échange:** Oui
- > **Crédits ECTS Echange:** 9.0
- > **Code d'export Apogée:** GBMG7U06

Présentation

Description

1. Rappels élémentaires de théorie des probabilités
2. Éléments de statistique
3. Espérance conditionnelle
4. Processus à temps discret
5. Martingales
6. Chaînes de Markov

Heures d'enseignement


| | | |
|----|----|-----|
| CM | CM | 33h |
| TD | TD | 48h |

Pré-requis recommandés

La partie Probabilités du cours de *Théorie de la mesure, introduction aux probabilités* en L3A.

Période : Semestre 7

Bibliographie

- Philippe Barbe, Michel Ledoux, *Probabilité L3-M1*, ÉDP Sciences 2007
- Bernard Bercu, Djalil Chafaï, *Modélisation stochastique et simulation, Cours et applications*, Dunod 2007
- Olivier Garet, *Probabilités et Processus Stochastiques : cours et exercices corrigés*, 2017
- Laurent Mazliak, Pierre Priouret, Paolo Baldi, *Martingales et chaînes de Markov*, Hermann 1998
- Djalil Chafaï, Florent Malrieu, *Recueil de Modèles Aléatoires*, Springer 2016, également  disponible sur HAL

Infos pratiques

Contacts

Responsables pédagogiques

Didier Piau

✉ didier.piau@univ-grenoble-alpes.fr

Responsables pédagogiques

Christophe Leuridan

Campus

› Grenoble - Domaine universitaire