



Objectifs

Introduction des concepts de base de la théorie des probabilités: espaces de probabilité, évènements, mesures de probabilité, indépendance, variables aléatoires, lois des grands nombres, convergence de séries aléatoires, convergence faible, fonctions caractéristiques, le théorème central limite, conditionnement.

Description

1. Rappel de la théorie de la mesure: espaces de probabilité, variables aléatoires, espérance, indépendance.
2. La loi des grands nombres: construction de variables indépendantes, les lemmes de Borel-Cantelli, convergence de séries aléatoires, les lois faible et forte des grands nombres.
3. Le théorème central limite : convergence faible, fonctions caractéristiques, le théorème central limite, processus de Poisson.
4. Conditionnement.

Divers

Commentaires

Heures (Hebdo)	4
Cours	2
Exercices	2
Pratique	0
Total	56

Langue	français
Semestre	Automne
Mode d'évaluation	Examen écrit
Session	Janvier

Format de l'enseignement	
--------------------------	--

Cursus	Type	ECTS
Baccalauréat universitaire en mathématique	N/A	6
Baccalauréat universitaire en mathématiques	N/A	5