

COURS MM036: PROCESSUS DE SAUTS

NICOLAS FOURNIER

Voici mon adresse électronique : `nicolas.fournier@upmc.fr`.

J'ai gardé le polycopié de Philippe Bougerol, qui est très bien et que je suivrai d'assez près. Le programme est un peu trop ambitieux, et je sauterai à coup sûr parties suivantes :

- les sections 3.2 et 3.3 (dans le chapitre 3, je ne ferai que la section 3.1) ;
- fin de la section 4.8 (à partir du haut de la page 56) ;
- preuve de l'équation forward (du lemme 5.3.5 jusqu'à "Elle doit donc être nulle partout." en haut de la page 69) ;
- la section 5.5 quasi-intégralement (on retiendra juste de cette section qu'une "probabilité réversible" est une probabilité π sur E telle que pour tout $i, j \in E$, $\pi(i)A(i, j) = \pi(j)A(j, i)$, et qu'une telle probabilité est alors invariante) ;
- la fin de la section 6.3 (à partir du Corollaire 6.3.5) ;
- la section 6.5 sera juste évoquée très rapidement (sans rigueur) ;
- le chapitre 7 sera très probablement omis.

Calendrier prévisionnel : en 12 cours de 2 heures,

Chap 1 : 3 heures,

Chap 2 et 3 : 5 heures,

Chap 4 : 8 heures,

Chap 5: 6 heures,

Chap 6: 2 heures.

Les feuilles de TD et leurs corrections vous seront transmises au fur et à mesure.

Enfin, je vous enverrai 2 devoirs. Le premier mi-février, le second mi-mars.

Cordialement,

Nicolas Fournier.