



SC

MATH2360 Processus stochastiques (statistique)

[30h] 3.5 credits

This course is taught in the 1st semester

Teacher(s): Jean-Marie Rolin
Language: french
Level: 2nd cycle course

Aims

Presentation of the main discrete time stochastic processes with an introduction to their statistical analysis.

Main themes

Discrete time Martingales (sub-martingales and super-martingales), stationary processes, exchangeable processes, conditionally i.i.d. processes and Markov processes.

Other credits in programs

MATH22/E	Deuxième licence en sciences mathématiques (Economie mathématique)	(3.5 credits)	
MATH22/G	Deuxième licence en sciences mathématiques	(3.5 credits)	
MATH22/S	Deuxième licence en sciences mathématiques (Statistique)	(3.5 credits)	Mandatory
STAT2MS	Master en statistique, orientation générale, à finalité spécialisée	(5 credits)	
STAT3DA	Diplôme d'études approfondies en statistique		
STAT3DA/M	Diplôme d'études approfondies en statistique (méthodologie de la statistique)	(5 credits)	