

Probabilités 2 : notions d'aléatoire en dimension multiple

Niveau : L2

Cursus :

Semestre : S3

Volume horaire : 12CM 12TD

Intervenant : Mathieu Sart + ?

Contact :

Objectifs du cours :

L'analyse statistique inférentielle s'appuie sur des outils probabilistes. La notion de loi d'une variable aléatoire a déjà été vu dans les cours précédents. Il s'agit ici de développer cette notion pour des couples de variables aléatoires.

La dernière partie porte sur les espaces euclidiens qui est l'outil naturel pour analyser la régression multiple en économétrie ainsi que les méthodes factorielles.

Plan de cours :

- 1) Couples de variables aléatoires discrètes
- 2) Notion d'intégration en dimension 2.
- 3) Couples de variables aléatoires continues
- 4) Espaces euclidiens

Modalités d'évaluation :

Evaluation en contrôle continu intégral.
Deux évaluations sont prévues.

Prérequis (à mentionner uniquement s'il y en a) :

Méthodes quantitatives 1 : mathématiques pour l'économie
Méthodes quantitatives 2 : algèbre linéaire
Probabilité et Intégration