

Table des matières

1. Introduction - Phénomènes aléatoires	1
2. Axiomes des probabilités	7
3. Probabilités conditionnelles et indépendance	15
4. Probabilités sur un espace fini ou dénombrable	23
5. Variables aléatoires sur un espace fini ou dénombrable	29
6. Construction d'une mesure de probabilité	37
7. Probabilités sur \mathbb{R} et fonctions de répartition	41
8. Variables aléatoires	51
9. Intégration par rapport à une mesure de probabilité	55
10. Variables aléatoires indépendantes	71
11. Lois de probabilité sur \mathbb{R}	83
12. Probabilités sur \mathbb{R}^n	93
13. Fonctions caractéristiques	109
14. Propriétés des fonctions caractéristiques	117
15. Sommes de variables aléatoires indépendantes	123
16. Variables aléatoires gaussiennes	131
17. Convergence des variables aléatoires	147
18. Convergence en loi	157
19. Convergence en loi et fonctions caractéristiques	173
20. La loi des grands nombres	179
21. Le théorème-limite central	187
22. L^2 et les espaces de Hilbert	195
23. Espérance conditionnelle	203
24. Martingales	217
25. Surmartingales et sous-martingales	225
26. Les inégalités de martingales	229
27. Les théorèmes de convergence de martingales	235
28. Le théorème de Radon-Nikodym	249
Bibliographie	255
Index des notations	257
Index	259