

USEA38 - Mathématiques du signal aléatoire pour le ferroviaire

Présentation

Objectifs pédagogiques

Acquérir des techniques utilisées dans l'étude des signaux aléatoires et plus généralement en électronique, - physique, etc ...

Compétences

Maîtriser les techniques d'intégration, analyse de Fourier, produit de convolution, transformée de Fourier et les propriétés des distributions.

Programme

Contenu

1. Analyse combinatoire. Analyse combinatoire sans répétition. Analyse combinatoire avec répétition.

2. Espaces de probabilités. Tribu d'événements. Axiomes de structure sur l'ensemble des événements.

Probabilités sur un espace probabilisable. Espaces de probabilités discrètes.

Événements indépendants. Modèles d'urnes. Probabilités conditionnelles.

Théorème de Bayes.

3. Variables aléatoires. Loi de probabilités d'une variable aléatoire discrète. Loi de probabilités d'une variable aléatoire continue. Fonction de répartition d'une loi de probabilités. Densité de probabilités. Moments d'une variable aléatoire. Variance. covariance. Coefficient de corrélation. Lois jointes. Lois marginales. Somme des variables aléatoires indépendantes. Lois conditionnelles. Espérance conditionnelle. Statistiques d'ordre.

4. Fonctions génératrices. Fonctions caractéristiques. Transformée de Laplace.

5. Lois usuelles. Loi uniforme sur un ensemble de cardinal fini. Loi de Bernoulli. Loi Binomiale. Loi Géométrique. Loi Binomiale négative. Loi Hypergéométrique. Loi de Poisson. Loi Multinomiale. Loi uniforme sur un intervalle. Loi triangulaire. Loi Normale. Loi Exponentielle. Loi Gamma. Loi Beta. Loi chi-deux. Loi de Student. Loi de Fisher.

6. Vecteurs aléatoires. Vecteurs Gaussiens. Matrice de Variance-Covariance. Transformations affines d'un vecteur aléatoire. Vecteurs gaussiens. La droite de régression.

7. Suites de variables aléatoires. Etudes asymptotiques. Convergence presque sûre. Convergence en probabilité. Convergence au sens de L^2 . Convergence en loi. Loi faible des grands nombres. Théorème central-limite.

8. Processus aléatoires. Processus aléatoires à temps discret. Processus aléatoires à temps continu. Processus stationnaires. Processus stationnaires au second ordre. Fonction d'autocorrélation. Spectre de puissance d'un signal stationnaire au second ordre. Bruit blanc. Modèles ARMA. Chaînes de Markov. Processus de Poisson. Mouvement Brownien.

Description des modalités de validation

Contrôle continu, Devoirs surveillés, projet à réaliser avec le logiciel Matlab

Bibliographie(s) :

[1] Ghorbanzadeh D. (1998). Probabilités. Exercices corrigés. **Éditions Technip, Paris**

Mis à jour le 07-05-2025



Code : USEA38

Unité spécifique de type cours

2 crédits

Responsabilité nationale :

EPN03 - Electroniques, électrotechnique, automatique et mesure (EEAM) / Catherine ALGANI

Contact national :

EPN - Secrétariat EASY

292 Rue Saint Martin

11 B2 36

75003 Paris

01 40 27 24 81

Virginie Dos Santos Rance

virginie.dos-santos-rance@lecnam.net

[2] Ghorbanzadeh D. , Marry P. , Point N., Vial D.(2002). Eléments de Mathématiques du Signal.
Exercices résolus. 2ème édition. Dunod, Paris