

Control of Markov chains

ECTS : 4

Volume horaire : 39

Description du contenu de l'enseignement :

Volume horaire détaillé :

CM : 19h30

TD : 19h30

Rappels et compléments sur les chaînes de Markov et les temps d'arrêt.

Analyse du problème d'arrêt optimal en horizon fini.

Stratégies optimales et chaînes de Markov contrôlées.

Compétence à acquérir :

Introduire à travers l'étude de cas simples les idées du contrôle stochastique et montrer l'importance de ces idées dans des applications courantes, en finance notamment.