

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.

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16 - 03/12/2025