

Discrete processes

**ECTS** : 4

**Volume horaire** : 37.5

**Description du contenu de l'enseignement :**

Volume horaire détaillé :

CM : 19h30

TD : 19h30

Espérance conditionnelle.

Martingales. Stratégies. Convergence des martingales. Arrêt optionnel.

Chaînes de Markov.

**Compétence à acquérir :**

Introduction à la modélisation aléatoire dynamique.

**Document susceptible de mise à jour - 13/02/2026**

**Université Paris Dauphine - PSL** - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16