

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.