

Recherche Monte-Carlo et Jeux

ECTS : 3

Volume horaire : 24

Description du contenu de l'enseignement :

Ce cours est une introduction aux méthodes dites de Monte-Carlo. Ces méthodes sont utilisées pour calculer des espérances, et par extension, des intégrales par simulation. L'objectif de ce cours est non seulement de fournir les bases théoriques des méthodes de Monte-Carlo, mais aussi de fournir les outils permettant leur utilisation pratique à travers des TP.

Le cours couvre les sujets suivants :

- introduction de la méthode de Monte-Carlo
- techniques de réduction de variance
- introduction aux suites à discrétion faible