

Processus Stochastiques

**ECTS** : 3

**Volume horaire** : 30

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

1. Intégrale stochastique
2. EDS et théorèmes de représentation
3. EDSR et théorèmes de représentation
4. Application au contrôle stochastique

**Compétence à acquérir :**

Approfondir les notions de processus stochastiques, équations différentielles stochastiques progressives (EDS) et rétrogrades (EDSR), lien avec les équations aux dérivées partielles (e.d.p) et application au contrôle stochastique

**Mode de contrôle des connaissances :**

Examen

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

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