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