

Processus discrets

**ECTS : 3**

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

Espérance conditionnelle.

Martingales. Stratégies. Convergence des martingales. Arrêt optionnel.

Chaînes de Markov.

Enseignant responsable : FRANCOIS SIMENHAUS

**Compétence à acquérir :**

Introduction à la modélisation aléatoire dynamique.

**Document susceptible de mise à jour - 07/02/2026**

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