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.