

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