

Control of Markov chains

ECTS : 4

Volume horaire : 39

Description du contenu de l'enseignement :

Volume horaire détaillé : CM : 19h30 TD : 19h30 Rappels et compléments sur les chaînes de Markov et les temps d'arrêt. Analyse du problème d'arrêt optimal en horizon fini. Stratégies optimales et chaînes de Markov contrôlées.

Compétence à acquérir :

Introduire à travers l'étude de cas simples les idées du contrôle stochastique et montrer l'importance de ces idées dans des applications courantes, en finance notamment.

Document susceptible de mise à jour - 02/04/2026

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