

Discrete processes

ECTS : 4

Volume horaire : 39

Description du contenu de l'enseignement :

Volume horaire détaillé : CM : 19h30 TD : 19h30 Espérance conditionnelle. Martingales. Stratégies. Convergence des martingales. Arrêt optionnel. Chaînes de Markov.

Compétence à acquérir :

Introduction à la modélisation aléatoire dynamique.

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

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