

Processus Stochastiques

ECTS : 3

Volume horaire : 30

Description du contenu de l'enseignement :

1. Processus stochastiques, processus à variations finies. 2 Intégrale stochastique, processus d'Ito, calcul stochastique.
3. EDS; exemples en finance.

Compétence à acquérir :

Approfondir les notions de processus stochastiques, équations différentielles stochastiques (EDS) , lien avec les équations aux dérivées partielles (e.d.p) et applications à la finance

Mode de contrôle des connaissances :

CC(30%) + Examen(70%)

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

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