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 - 05/11/2026
Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16