

US331E - Modèles stochastiques

Présentation

Objectifs pédagogiques

Maîtrise des outils fondamentaux en optimisation stochastique

Programme

Contenu

Présentation dans le cas discret des problèmes de commande optimale stochastique. On commencera par formuler le problème en insistant sur la notion de structure d'information. On présentera ensuite le cas des chaînes de Markov, puis de la commande optimale (horizon fini ou infini, information complète ou non, temps d'arrêt), et on détaillera le cas LQG. On présentera aussi quelques méthodes de résolution (programmation dynamique, itérations sur les valeurs, itérations sur les politiques, ...)

✿ Mis à jour le 11-04-2019



Code : US331E

Unité spécifique de type cours

2 crédits

Responsabilité nationale :

EPN05 - Informatique / 1

Contact national :

Recherche opérationnelle

2D4P20, 33-1-10, 2 rue Conté

75003 Paris

01 40 27 22 67

secretariat.ro@cnam.fr