

République Algérienne Démocratique et populaire  
Ministère de l'Enseignement Supérieur et de la Recherche Scientifique

UNIVERSITE MOHAMED KHIDER BISKRA  
FACULTE DES SCIENCES EXACTES ET DES SCIENCES DE LA  
NATURE ET DE LA VIE

DEPARTEMENT DE MATHEMATIQUES



# MEMOIRE

Présenté en vue de l'obtention du diplôme de  
**Magister en Mathématiques**

Par

**AOUN Salima**

Spécialité: Mathématiques

Option: Probabilités Statistique

Thème

**CONTROLE OPTIMAL STOCHASTIQUE ET  
APPLICATION EN FINANCE**

**Soutenu le: 17/05/2010**

**Devant le jury composé de:**

|             |             |     |              |
|-------------|-------------|-----|--------------|
| Président:  | A. NECIR    | Pr  | U.M.K.Biskra |
| Rapporteur: | B. MEZERDI  | Pr  | U.M.K.Biskra |
| Examineur:  | K.MELKEMI   | Pr  | U.M.K.Biskra |
| Examineur:  | D. MERAGHNI | M.C | U.M.K.Biskra |