

ÉQUATIONS DE KOLMOGOROV (N2)

(18 / 05 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

On appelle **équations de KOLMOGOROV** un couple constitué de deux **équations différentielles**, l'une appelée **équation avant**, l'autre **équation arrière**, qui caractérisent les **matrices de transition** d'une **chaîne de MARKOV** en **temps continu** ($T = \mathbf{R}_+$ ou $T = \mathbf{R}$) (cf **états d'une chaîne de MARKOV**).