

Date: MARDI 27 NOVEMBRE à 14H30.

Lieu: Salle de convivialité

Conférencière: Céline LACAUX

Titre: Equations différentielles stochastiques

Résumé: Je présenterai les bases du calcul stochastique pour le mouvement brownien et des liens entre EDP et EDS.

Si le temps me le permet, j'évoquerai succinctement la théorie des "trajectoires rugueuses" (https://en.wikipedia.org/wiki/Rough_path) :

cette théorie permet notamment de définir des intégrales stochastiques dans un cadre de processus très irréguliers (e.g. brownien fractionnaire).