

Étude asymptotique d'un processus renforcé

Aline Kurtzmann (Université de Nancy)
Victor Kleptsyn (Université de Rennes)

Vendredi 21 mai 2010 à 15h00, salle de réunion (B413)

Un processus renforcé est solution d'une équation différentielle stochastique, dont le terme de dérive dépend à la fois de la position actuelle et de toute la trajectoire passée. Nous étudierons le comportement asymptotique d'une telle diffusion à valeurs réelles. À l'aide d'un système dynamique (déterministe) et de la décroissance de l'entropie (énergie libre) associée au système, nous obtiendrons le comportement ergodique (au sens de Birkhoff) de la diffusion, avec une estimation de la vitesse de convergence.

Séminaire de Mathématiques Appliquées et de Calcul Scientifique du CERMICS
Ecole des Ponts ParisTech, 6-8 avenue Blaise-Pascal, 77455 Champs-sur-Marne, France
<http://cermics.enpc.fr/seminaires/cs/index.html>