

Problème du temps de sortie pour des processus non-markoviens

mardi 11 juin 2024 11:10 (30 minutes)

Dans cet exposé, nous discuterons d'abord du problème du temps de sortie : sa formulation et les résultats existants dans le cas de la diffusion d'Itô (connue sous le nom de théorie de Freidlin-Wentzell). Ensuite, la diffusion auto-interagissante (self-interacting diffusion, SID) sera présentée. Ce processus interagit de manière trajectorielle avec son propre chemin. Les résultats de temps de sortie dans ce cas non-markovien, obtenus en collaboration avec Pierre Del Moral, Aline Kurtzmann et Julian Tugaut, seront présentés.

Auteur principal: ALEKSIAN, Ashot

Orateur: ALEKSIAN, Ashot