



Charles-Edouard Bréhier

Du 9 novembre 2022 au 9 novembre 2022

LMAP, UPPA, Pau

Page web : https://lma-umr5142.univ-pau.fr/fr/organisation/membres/cv_-cebrehier-fr.html | 📄

Titre : Schémas préservant l'asymptotique pour des systèmes stochastiques

Résumé : L'objectif de cet exposé est d'illustrer la construction de schémas numériques efficaces appliqués à différents systèmes d'équations différentielles stochastiques, dans des régimes asymptotiques (moyennisation et homogénéisation). On montrera la supériorité de schémas qui préservent l'asymptotique, et on verra qu'on peut parfois obtenir des estimations d'erreur uniforme. Enfin, on évoquera des résultats et des pistes de généralisations pour des systèmes d'équations aux dérivées partielles stochastiques.