

# Colloquium de Mathématiques de Pau

Jeudi 16 octobre 2014 à 14h, Amphi G

**Gabriel Lord**

Professeur à l'Université Heriot-Watt de Édimbourg

## Méthodes numériques pour les ondes stochastiques

**Résumé :** J'introduirai les équations différentielles et les équations aux dérivées partielles stochastiques, dans lesquelles l'intégrale stochastique est interprétée au sens de Stratonovich. Je présenterai une méthode d'approximation numérique de ces équations, avec pour application l'étude d'ondes dans les équations aux dérivées partielles stochastiques. Je montrerai une technique qui fait que l'onde est stationnaire. Quelques simulations numériques illustreront ces résultats.

**contacts :**

[jvalles@univ-pau.fr](mailto:jvalles@univ-pau.fr) et [igreff@univ-pau.fr](mailto:igreff@univ-pau.fr)

**Prochain Colloquium : 11 Décembre 2014**

