

Équations aux dérivées partielles stochastiques : Équations différentielles stochastiques dirigées par un mouvement brownien fractionnaire (Document en Français)

▼ Accès au(x) document(s)

Accéder au(x) document(s) :

<http://indexation.univ-fcomte.fr/nuxeo/site/esupversions/42b6ac08-e8a6-498b-bdab-3>

Ce document est protégé en vertu du Code de la Propriété Intellectuelle.

Version :

- **Thèse avec 2 versions : seule la version intégrale est proposée ; sur authentification (communication intranet).**

▼ Informations sur les contributeurs

Auteur : Sausserieau, Bruno

Date de soutenance : 12-11-2012

Diplôme : HDR

Etablissement de soutenance : Université de Franche-Comté

Laboratoire : Laboratoire de Mathématiques de Besançon

▼ Informations générales

Discipline : mathématiques

Classification : Mathématiques

Mots-clés libres : Processus de Mouvement brownien, Équations aux dérivées partielles linéaires

Résumé : Ce texte représente une synthèse de mes activités de recherche qui s'articulent principalement autour de deux thèmes : les équations aux dérivées partielles stochastiques et équations différentielles stochastiques dirigées par un mouvement brownien fractionnaire. Le conducteur des différents travaux que j'ai menés est certainement l'étude de comportement qualitatif de solutions d'équations stochastiques, qu'elles soient aux dérivées partielles ou différentielles fractionnaires. En effet, même si une partie des résultats concerne des problèmes d'existence et d'unicité, ou de calcul de Malliavin, l'étude des trajectoires, la comparaison entre comportements provenant d'un mouvement brownien fractionnaire et ceux provenant d'un mouvement brownien classique sont toujours des motivations que j'ai en tête et qui motivent le développement et l'étude d'outils et de propriétés plus abstraites

Équations aux dérivées partielles stochastiques : Équations différentielles stochastiques dirigées par un mouvement brownien fractionnaire, Stochastic partial differential equations : stochastic differential equations governed by a fractional Brownian motion (Document en Français)

▼ Accès au(x) document(s)

Accéder au(x) document(s) :

[↗ http://indexation.univ-fcomte.fr/nuxeo/site/esupversions/42b6ac08-e8a6-498b-bdab-3](http://indexation.univ-fcomte.fr/nuxeo/site/esupversions/42b6ac08-e8a6-498b-bdab-3)

▼ Informations générales

Auteur(s) : Saussereau, Bruno

Structure(s) associée(s) :

- Université de Franche-Comté

Date de publication : 12-11-2012

Description :

- Ce texte représente une synthèse de mes activités de recherche qui s'articulent principalement autour de deux thèmes : les équations aux dérivées partielles stochastiques et les équations différentielles stochastiques dirigées par un mouvement brownien fractionnaire. Le fil conducteur des différents travaux que j'ai menés est certainement l'étude du comportement qualitatif de solutions d'équations stochastiques, qu'elles soient aux dérivées partielles ou différentielles fractionnaires. En effet, même si une partie des résultats concerne des problèmes d'existence et d'unicité, ou de calcul de Malliavin, l'étude des trajectoires, la comparaison entre les comportements provenant d'un mouvement brownien fractionnaire et ceux provenant d'un mouvement brownien classique sont toujours des motivations que j'ai en tête et qui motivent le développement et l'étude d'outils et de propriétés plus abstraites
- No summary available

Type de publication : Electronic Thesis or Dissertation, Text

Mots clés : Processus de Mouvement brownien, Équations aux dérivées partielles linéaires, AMS : 60407, 60410, 60415, 60422