

SÉMINAIRE QUANTACT

Djilali AIT AOUDIA
UQAM

Le temps d'occupation pour des processus diffusifs avec sauts hyperexponentiels

Résumé :

Dans cet exposé, nous allons étudier la loi du temps d'occupation pour des processus diffusifs avec sauts hyperexponentiels. En premier lieu, nous rappelons le cadre général des modèles diffusifs avec sauts, en particulier les modèles avec des sauts hyperexponentiels. Ensuite, nous revenons sur un certain nombre de résultats, dont ceux de N. Cai, N. Chen et X. Wang. On passera en revue quelques éléments ci-dessus et on présentera une nouvelle approche permettant de calculer explicitement la transformée de Laplace du temps d'occupation pour ces processus diffusifs. Il s'agit d'un travail effectué en collaboration avec Jean-françois Renaud.

Mercredi 20 novembre 2013, 13:00-14:00

PK-5115

Département de mathématiques,

UQAM

Horaire du séminaire : www.math.uqam.ca/renaudjf/seminaires.html