
Comportement en temps long du schéma d'Euler d'une EDS à mémoire.

Maylis Varvenne*¹

¹Institut de mathématiques de Toulouse (IMT) – Université Paul Sabatier-Toulouse III - UPS – 118
route de Narbonne 31400 Toulouse, France

Résumé

On s'intéresse à des dynamiques discrètes de la forme : $X_{n+1} = h \cdot b(X_n) + \sigma(X_n) * \Delta_{n+1}$ où (Δ_n) correspond aux accroissements, supposés stationnaires et ergodiques, d'un processus Gaussien (Z_t) . On peut alors introduire un processus Markovien. D'autre part, sous certaines conditions reliées à la fonction de covariances de la suite (Δ_n) , nous pouvons obtenir des résultats introduits par M. Hairer, puis J. Fontbona & F. Panloup, et A. Deya, F. Panloup et S. Tindel dans un cadre continu pour des EDS fractionnaires.

*Intervenant