

Séminaire de Probabilités et Statistique

Mardi 04 Juin à 14h00

Laboratoire Dieudonné
Salle de conférences - LJAD

Paul-Éric Chaudru de Raynal

LAMA, Université de Savoie Mont-Blanc

*Equation de Kolmogorov sur l'espace de Wasserstein :
application à la restauration d'unicité et à la propagation du
chaos.*

Dans cet exposé nous nous intéresserons aux effets régularisants de l'équation de Kolmogorov sur l'espace de Wasserstein. Cette équation décrit la dynamique du semi-groupe généré par la solution d'une équation différentielle stochastique de type McKean-Vlasov (i.e. dont la dynamique dépend de la loi). Nous verrons comment de tels effets permettent de retrouver des résultats d'unicité faible et forte ainsi que des phénomènes de propagation du chaos pour des équations à coefficients peu réguliers.