

Session 4 - Probabilités numériques

Samedi 25.08	Présentations
15:00 - 15:30	V. Lemaire - Vitesses de convergence pour l'approximation de la mesure invariante d'un processus de diffusion
15:30 - 16:00	F. Avram - On moments based matrix-exponential approximations of the Pollaczek-Khinchine formula
16:00 - 16:30	S. Maire - Méthodes de différences finies pour la simulation Monte Carlo de diffusions en milieu hétérogène
16:30 - 17:00	R. Roux - Systèmes de particules pour la résolution des lois de conservation fractionnaires scalaires
17:00 - 17:30	pause café

Lundi 27.08	Présentations
15:00 - 15:30	F. Dufour - Numerical approximation of constrained discounted Markov decision processes
15:30 - 16:00	Gh. Zbaganu - Portfolio theory: when diversification is necessary?
16:00 - 16:30	B. de Saporta - Arrêt optimal pour les processus Markoviens d'eterministes par morceaux partiellement observés
16:30 - 17:00	N. Champagnat - Algorithmes de Monte Carlo pour l'équation de Poisson-Boltzmann en dynamique moléculaire
17:00 - 17:30	pause café
17:30 - 18:00	L. Violeau - Analyse numérique des processus stochastiques cinétiques de type McKean conditionnel
18:00 - 18:30	A. Lazari - Compositions des systèmes stochastiques avec séquence finale des états
18:30 - 19:00	F. Panloup - Approximation fonctionnelle du régime stationnaire d'une diffusion et problèmes associés