

Marches aléatoires excitées et mouvement Brownien excité en dimension 1

Bruno Schapira

30/03/2010

Le modèle de marches excitées est un des modèles les plus élémentaires de processus aléatoires interagissant avec sa trajectoire passée (en particulier non Markovien). Je commencerai par un bref exposé des résultats les plus significatifs obtenus ces dernières années, puis je parlerai d'une version continue, appelée Mouvement brownien excité, dont on verra qu'il se comporte de manière similaire, et peut être vu comme limite à grande échelle d'une suite de marches excitées. (travail en commun avec Olivier Raimond.)