

UNICAMP – IMECC
Departamento de Matemática

Seminário de Sistemas Dinâmicos e Estocásticos

Expositor: R. A. Castrequini (UNICAMP)

Título: Método das características generalizado e
equação estocástica de transporte

Data: Sexta-feira, 17 de junho de 2011, 13h30min

Local: Sala 321 do IMECC

Resumo. Este método consiste em resolver a equação em questão reduzindo o problema a um sistema auxiliar de equações ordinárias determinísticas pouco regulares (no sentido dos *rough paths*). Neste seminário, discutiremos o método e apresentaremos alguns aspectos da teoria de *rough paths* (a qual vem se mostrando bastante adequada para estudar equações estocásticas de um ponto de vista determinístico). Comparamos, por exemplo, a solução encontrada com a solução obtida via cálculo estocástico usual.

Consulte a programação em [www.ime.unicamp.br/ssde].