

東北大学大学院情報科学研究科数学教室

情報数理談話会のお知らせ

日 時： 2012 年 11 月 28 日 (水) 16:00 から 17:00 まで
(15:40 より会場にお茶を用意しております)

場 所： 東北大学大学院情報科学研究科棟 2 階大講義室

講演者： Philippe Blanchard 氏 (University of Bielefeld, Faculty of Physics and ZiF)

題 目： On stochastic processes driven by ballistic noise sources

〈 概要 〉 I will focus on Markov processes that themselves are functions of the standard Brownian motion. These noise sources can be viewed as lumped versions of Markov processes with enlarged states spaces. The resulting Markov processes exhibit ballistic non-Gaussian noise features with long time range correlations. I will give applications to quantum theory, financial mathematics and Kuramoto-Sakaguchi coupled dynamics.

ホームページ： <http://www.math.is.tohoku.ac.jp/research/colloquium.html>