

Problèmes d'information dans les jeux en temps continu

Pierre Cardaliaguet, CEREMADE

Mots-clés :

Résumé : Les jeux en temps continus (ou jeux différentiels) étudient des situations dans lesquelles plusieurs agents contrôlent un même système qui évolue—de façon déterministe ou stochastique—continuellement en temps. Après un tour d'horizon de problématiques récemment introduites dans ce domaine (analyse des équilibres de Nash par des méthodes de lois de conservations, jeux à grand nombre de joueurs (dits “jeux champs moyen”)), on présentera une famille de modèles dans lesquels un des joueurs a plus d'information sur le système que son adversaire. On montrera comment ces jeux sont liés à des équations de Hamilton-Jacobi assez particulières, ainsi qu'à des problèmes d'optimisation de martingales.