

Approximer des processus de type Lévy

Mihai GRADINARU, Université de Rennes 1

On s'intéresse à la caractérisation de la convergence de certains processus de Markov en temps discret vers des processus localement Feller, plus précisément vers de processus de type Lévy. On introduit une localisation en espace pour étudier les processus localement felleriens et un problème local de martingale. En utilisant ces outils on obtient des résultats de convergence de certains marches aléatoires vers des diffusions évoluant dans des potentiels singuliers ou aléatoires. Il s'agit d'un travail en collaboration avec Tristan Haugomat.

Références

- [1] M. GRADINARU, T. HAUGOMAT, *Convergence and discrete schemes applied to some Lévy-type processes*, arXiv:1707.02889, 2017.