

SEMINAR XÁC SUẤT THỐNG KÊ

Khoa Toán-Tin học thông báo seminar

Địa điểm: Trường ĐH. Khoa Học Tự Nhiên, 227 Nguyễn Văn Cừ, Quận 5, Tp Hồ Chí Minh. Phòng F207, vào lúc 9h sáng, thứ 7 (26/08/2017)

Người trình bày: GS. Marc Peigné, Chủ tịch Hội Toán học Pháp (<http://www.lmpt.univ-tours.fr/~peigne/>) đang làm việc tại Laboratoire de Mathématiques et Physique Théorique (ĐH. Fr. Rabelais, Tours, Pháp).

Đối tượng tham gia: giảng viên, học viên cao học và sinh viên ngành Toán.

Nội dung:

- giới thiệu nội dung giảng dạy và hướng nghiên cứu xác suất thống kê của GS. Marc Peigné.
- thông tin học bổng thực tập Master, PhD tại các đại học của Pháp.
- bài giảng: **Affine recursion and invariant measure**, tóm tắt nội dung:

We study the existence and unicity of invariant measure on \mathbb{R} of the Markov chain $(X_n)_{n \geq 0}$ defined by $X_0 = x$ and, for all $n \geq 1$

$$X_n := a_n X_{n-1} + b_n$$

where the (a_n, b_n) , $n \geq 1$, are i.i.d. random variables with values in $\mathbb{R}^{*+} \times \mathbb{R}$. Both cases $\mathbb{E}(\log a_n) < 0$ and $\mathbb{E} \log a_n = 0$ will be considered; they lead to strongly different behaviours.

This Markov chain is a fundamental example of stochastic dynamical system and appears in several classical situations, as perpetuities, speculative prices, . . . and random walks on groups of matrices.

Kính mời mọi người quan tâm tới dự.