



ÉCOLE POLYTECHNIQUE
FÉDÉRALE DE LAUSANNE

***Institut de mathématiques des sciences computationnelles et ingénierie
MATHICSE***

***SEMINAIRE D'ANALYSE
NUMERIQUE***

➤ ***MERCREDI 13 AVRIL 2011 à 16h15 à la salle MA A110***

Prof. DAVID COHEN (UNIVERSITE DE BALE, SUISSE) donnera une conférence intitulée:

"Convergence analysis of trigonometric methods for stiff second-order stochastic differential equations."

We will discuss the numerical discretisation of stochastic oscillators with high frequency. The proposed explicit numerical schemes permit the use of large step sizes and offer various additional properties. These new numerical integrators can be viewed as a stochastic-generalisation of the trigonometric integrators for highly oscillatory deterministic problems.

Lausanne, le 18 mars 2011
Prof. Assyr Abdulle / nk

Les séminaires qui ont lieu à la Section de Mathématiques sont annoncés sur Internet
(<http://memento.epfl.ch/cgi-bin/memento/select?memento=MATHS>)