

Application BASTRI

Fiches Equipes

TOSCA-NGE (SR0857FR)

Simuler et calibrer des modèles stochastiques
TOSCA (SR0170XR) □ TOSCA-NGE □ PASTA (SR0900AR)

Statut: Terminée

Responsable : Madalina Deaconu

Mots-clés de "A - Thèmes de recherche en Sciences du numérique - 2024" : *Aucun mot-clé.*

Mots-clés de "B - Autres sciences et domaines d'application - 2024" :
Aucun mot-clé.

Domaine : Mathématiques appliquées, calcul et simulation
Thème : Approches stochastiques

Période : 20/12/2018 -> 30/11/2020
Dates d'évaluation :

Etablissement(s) de rattachement : <sans>
Laboratoire(s) partenaire(s) : <sans UMR>

CRI : Centre Inria de l'Université de Lorraine
Localisation : Centre Inria de l'Université de Lorraine
Code structure Inria : 051078-0

Numéro RNSR : 201822955C
N° de structure Inria: SR0857FR

Présentation

Le plus souvent, les physiciens, les économistes, les biologistes et les ingénieurs font appel à des modèles stochastiques car ils ne peuvent pas décrire leurs expériences physiques, économiques, biologique, etc., avec des systèmes déterministes, soit parce que les expériences sont trop complexes, soit parce qu'une calibration précise des paramètres du modèle serait impossible. Dans ce cas, on abandonne l'idée de pouvoir décrire l'état du système dans le futur, connaissant son état initial ; on cherche plutôt à donner une description statistique de l'évolution du système. Par exemple, on cherche à calculer les probabilités de réalisation d'événements critiques tels que des pertes élevées en finance, le franchissement d'un seuil par le potentiel électrique d'un neurone, ou encore la fragmentation très fine de particules de minerai dans un broyeur. La nature même de ces problèmes conduit à des modèles complexes : nous devons choisir des modèles stochastiques appropriés ce qui demande une connaissance fine de leurs propriétés. Nous devons alors les calibrer : nous utilisons des méthodes statistiques spécifiques pour tenir compte du manque ou de l'imprécision de données. De plus, après avoir choisi une famille de modèles et calculé les statistiques souhaitées, nous avons à estimer la sensibilité de nos résultats aux paramètres du modèle.

Nous développons des méthodes de simulation et calibration pour des Equations Différentielles Stochastiques générales, dont les coefficients et les conditions aux bords ont les singularités imposées par la physique ou la finance, etc., ce qui rend les solutions difficiles à discrétiser et à estimer.

Nous considérons des modèles réels et cela nous conduit à modéliser en dialoguant avec des physiciens, des biologistes, des ingénieurs, etc. et en exploitant la richesse de la théorie des processus stochastiques.

Axes de recherche

- Problèmes transverses
 - Simulation en temps long des EDP non linéaires ;
 - Simulation de modèles multivalués ;
 - Techniques de réduction de variance ;
 - Equations aux dérivées partielles stochastiques.
- Modèles stochastiques en biologie
- Modèles stochastiques en finance
- Modèles stochastiques de diffusion en milieu aléatoire
- Modèles stochastiques en mécanique des fluides
- Logiciels, expérimentation numérique

Contact

- **Responsable :** Madalina Deaconu
- **Tél :** 03.72.74.54.00
- **Secrétariat Tél :** 03.72.74.54.00

En savoir plus

- Site sur inria.fr
- Site du [responsable](#)
- Derniers Rapports d'Activité : [2020](#)

Documents sur la structure

- [Intranet](#)
- [Privés](#)

Décisions

- [13308](#) (04/01/2019) : création
- [14040](#) (16/12/2019) : fermeture
- [14233](#) (25/03/2020) : prolongation
- [14327](#) (16/06/2020) : prolongation
- [14508](#) (09/11/2020) : prolongation
- [14547](#) (30/11/2020) : fermeture

Localisation

- **Adresse postale :** Centre Inria de l'Université de Lorraine, 615 rue du Jardin Botanique, 54600 Villers-lès-Nancy France
- **Coordonnées GPS :** 48.666, 6.157

Relations industrielles et internationales

Nous avons des collaborations suivies avec

- A. Kohatsu-Higa (Université d'Osaka)
- Des probabilistes chiliens (R. Rebolledo, S. Torres et C. Mora)

Nous avons récemment eu des collaborations avec des partenaires industriels

- Credit Agricole CIB (ex Calyon)
- Natixis