

Un théorème limite central pour des marches aléatoires dans des cônes du plan.

Rodolphe Garbit

► **To cite this version:**

Rodolphe Garbit. Un théorème limite central pour des marches aléatoires dans des cônes du plan.. Journées MAS et Journée en l'honneur de Jacques Neveu, Aug 2010, Talence, France. <inria-00510338>

HAL Id: inria-00510338

<https://hal.inria.fr/inria-00510338>

Submitted on 18 Aug 2010

HAL is a multi-disciplinary open access archive for the deposit and dissemination of scientific research documents, whether they are published or not. The documents may come from teaching and research institutions in France or abroad, or from public or private research centers.

L'archive ouverte pluridisciplinaire **HAL**, est destinée au dépôt et à la diffusion de documents scientifiques de niveau recherche, publiés ou non, émanant des établissements d'enseignement et de recherche français ou étrangers, des laboratoires publics ou privés.

Journées MAS 2010, Bordeaux

Session : Quelques applications de l'auto-similarité stochastique.

Un théorème limite central pour des marches aléatoires dans des cônes du plan.

par **Rodolphe Garbit**

Le méandre d'un cône de l'espace euclidien est un processus obtenu à partir du mouvement brownien en le conditionnant à rester dans ce cône durant une unité de temps. Lorsque le cône est un demi-espace, on retrouve le méandre brownien usuel. Nous montrerons qu'une marche aléatoire conditionnée à rester dans un cône du plan converge en loi vers le méandre correspondant si et seulement si la queue de la loi du temps de sortie du cône est à variation régulière. Cette condition est satisfaite dans de nombreuses situations.

Adresse :

Rodolphe GARBIT

LAREMA

Université d'Angers, Faculté des Sciences

2, Boulevard Lavoisier, 49045 Angers Cedex 1, France

E-mail : garbit.rodolphe@gmail.com

<<http://rodolphe-garbit.comuf.com/>>

Session : Quelques applications de l'auto-similarité stochastique.