

An introduction to Gaussian measures

14M264 | Vincent Vargas



Heures (Hebdo) 4.0

Cours 2.0

Exercices 2.0

Pratique 0.0

Total 56.0

Langue français

Semestre Automne

Mode d'évaluation Examen écrit

Session Janvier

Format de l'enseignement Cours, exercices

Cursus Type ECTS

Baccalauréat universitaire en mathématiques N/A 6.0

Baccalauréat universitaire en mathématiques, informatique et sciences numériques N/A 6.0

Maîtrise universitaire en mathématiques N/A 6.0

Maîtrise universitaire en mathématiques, informatique et sciences numériques N/A 6.0

Objectifs

Description

Possible topics include harmonic analysis, partial differential equations, and geometrical measure theory.

In this course, I will present the general theory of Gaussian measures and introduce the fundamental tools in their study : integration by parts, Cameron-Martin space and theorem, Wick ordering, Wiener chaos decompositions, etc...

I will illustrate these concepts on fundamental examples like Brownian motion and the 2d Gaussian Free Field.