



Clément Rey

Mes travaux se concentrent principalement sur l'étude et la mise en œuvre de méthodes numériques pour les processus aléatoires. Je m'intéresse notamment à la quantification d'incertitude, l'approximation de processus Markoviens, à la construction de mesures invariantes de processus Felleriens ou encore à l'estimation de paramètres pour des Equations Différentielles Stochastique.

J'ai réalisé ma thèse au sein du Cermics (Ponts et Chaussées) sous la direction d'Aurélien Alfonsi et de Vlad Bally. J'ai ensuite réalisé un postdoctorat au LPMA (Paris 6) sous la supervision de Gilles Pagès et un postdoctorat au sein du CREST (ENSAE) sous la direction de Peter Tankov.