ANNALES SCIENTIFIQUES
DE L'UNIVERSITÉ DE CLERMONT-FERRAND 2
Série Mathématiques

PH. ARTZNER

Un modèle probabiliste de tâtonnement non-walrasien

Annales scientifiques de l'Université de Clermont-Ferrand 2, tome 61, série *Mathématiques*, nº 14 (1976), p. 3

<http://www.numdam.org/item?id=ASCFM_1976__61_14_3_0>

© Université de Clermont-Ferrand 2, 1976, tous droits réservés.

L'accès aux archives de la revue « Annales scientifiques de l'Université de Clermont-Ferrand 2 » implique l'accord avec les conditions générales d'utilisation (http://www.numdam.org/conditions). Toute utilisation commerciale ou impression systématique est constitutive d'une infraction pénale. Toute copie ou impression de ce fichier doit contenir la présente mention de copyright.

NUMDAM
Article numérisé dans le cadre du programme
Numérisation de documents anciens mathématiques
http://www.numdam.org/

UN MODELE PROBABILISTE DE TATONNEMENT NON-WALRASIEN

PH. ARTZNER, U.L.P. STRASBOURG

(Les notations sont celles du Cours d'Eté de T.M. LIGGETT, Saint-Flour 1976.)

On considère le processus de Markov ayant pour espace d'états $X = \{0, 1, 2\}^{\mathbb{Z}}$, et dont le générateur infinitésimal est défini sur $\mathfrak{F} \subset C(X)$ par :

$$\Omega f(\eta) = \sum_{\substack{(x,y)\in\mathbb{Z}^2 \\ |x-y|=1}} (\eta(x) - \eta(y))^+ \left(f(\eta_{xy}) - f(\eta)\right), \quad \eta \in X,$$

où η_{xy} ne diffère de η que par les conditions $\eta_{xy}(x) = \eta(x) - 1$, $\eta_{xy}(y) = \eta(y)+1$.

<u>Problème</u> :

Soient μ une probabilité quelconque sur X, I une partie bornée de $\mathbb{Z}$, et C_I l'ensemble des $\eta \in X$ tels que :

$$\sup_I \eta - \inf_I \eta \leq 1 .$$

Est-il vrai que $\lim_{t\to\infty} \mu_t(C_I) = 1$?