

**Journées de Probabilités 2014**  
26-30 mai 2014 au CIRM, Marseille

**Etude de la différentiabilité au sens de Malliavin  
d'une EDSR**

Thibaut MATROLIA (Université Paris Dauphine)

Dans cet exposé, on présentera de nouvelles conditions pour garantir la différentiabilité au sens de Malliavin d'un couple de processus  $(Y, Z)$  solution d'une équation différentielle stochastique rétrograde (EDSR). Ces dernières se déduisent d'une nouvelle caractérisation de l'espace des variables aléatoires Malliavin différentiables sur l'espace de Wiener que nous obtenons.

Cet exposé est basé sur un travail en collaboration avec Dylan Possamaï et Anthony Réveillac.