

Unité de probabilités

Séminaires programmés

[EPFL](#) > [Faculté SB](#) > [IMA](#) > [PROB](#) & [PRST](#) > [Séminaires](#) > P. Patie - 5 mars
french only

Conférence en probabilité

Mercredi 5 mars à 10h15
[MA 12](#), EPFL, Ecublens

[Dr. Pierre Patie](#)

[Université de Berne](#)

Loi de la fonctionnelle exponentielle associée à des processus de Lévy complètement asymétriques.

Résumé

J. Bertoin et M. Yor ont déterminé la loi de la fonctionnelle exponentielle d'un processus de Lévy spectralement positif par l'intermédiaire de leurs moments entiers négatifs. Dans cet exposé, nous commençons par calculer la transformée de Laplace, qui s'exprime à l'aide de nouvelles séries entières, d'une telle fonctionnelle pour un processus de Lévy spectralement négatif. Nous poursuivons par introduire une nouvelle famille de processus de Lévy et nous fournissons une expression pour la densité de leurs fonctionnelles exponentielles en termes des fonctions hypergéométriques de Wright. Nous finissons par proposer d'intéressantes propriétés analytiques dont jouissent ces fonctions spéciales.

date de mise à jour : septembre 06

