
Processus localement Feller et applications aux processus de type Lévy

Tristan Haugomat*¹

¹Institut de Recherche Mathématique de Rennes (IRMAR) – Université de Rennes 1 – Campus de Beaulieu, bâtiments 22 et 23, 263 avenue du Général Leclerc, CS 7420535042 RENNES Cédex, France

Résumé

Afin d'obtenir un cadre sympathique pour étudier les processus de Markov, on commencera par observer l'équivalence entre plusieurs notions : être la solution d'un problème de martingale bien posé, être localement égal à un processus de Feller et être continu en loi par rapport à l'état de départ (et markovien).

Ensuite, nous verrons quelques résultats généraux sur les processus localement Feller, notamment sur la localisation et la convergence.

Enfin, nous regarderons le cas particulier des processus de type Lévy et nous en déduirons des méthodes d'approximation.

*Intervenant