

Catherine Donati-Martin

Liste de publications

- [1] Mouvement brownien et inégalité de Hardy (avec M. Yor), *Séminaire de Probabilités XXIII, Lect. Notes in Math.* **1372** (1989), 315-323.
- [2] Le problème de Buffon-Synge pour une corde, *Adv. in Appl. Probability* **22** (1990), 375-395.
- [3] Transformation de Fourier et temps d'occupation browniens, *Prob. Th. and Rel. Fields* **88** (1991), 137-166.
- [3a] Transformation de Fourier et temps d'occupation browniens, *Note CRAS* **308**, Série I (1989), 515-517.
- [4] Equations différentielles dans \mathbb{R} avec conditions aux bords, *Stochastics* **35** (1991), 143-173.
- [5] Fubini's theorem for double Wiener integrals and the variance of Brownian path (avec M. Yor), *Annales de l'IHP* **27-2** (1991) 181-200.
- [6] Extension d'une formule de Paul Lévy pour la variation quadratique du mouvement brownien plan (avec M. Yor), *Bulletin des Sciences Mathématiques 2^{ème} série*, **116** (1992), 353-382.
- [7] Quasi-linear elliptic stochastic partial differential equations. Markov property, *Stochastics* **41** (1992), 219-240.
- [8] White Noise driven SPDEs with reflection (avec E. Pardoux), *Probab. Theory Relat. Fields* **95** (1993), 1-24.
- [9] On some examples of quadratic functionals of Brownian motion (avec M. Yor), *Journal of Applied Probability* **25** (1993), 570-594.
- [10] Propriété de Markov des équations stationnaires discrètes quasi-linéaires, *Stochastic Process. Appl.* **48** (1993), 61-84.

- [11] Markov property for elliptic stochastic partial differential equations (avec D. Nualart), *Stochastics and Stochastics Reports* **46** (1994), 107-115.
- [12] On symmetric stable random variables and matrix transposition (avec S. Song et M. Yor) *Annales de l' I.H.P.* **30-3** (1994), 397-413.
- [13] Symmetric stable processes, Fubini's theorem and some extensions of the Ciesielski-Taylor identities in law (avec S. Song et M. Yor), *Stochastics and Stochastics Reports* **50** (1994), 1-33.
- [14] EDPS réfléchies et calcul de Malliavin (avec E. Pardoux), *Bulletin des Sciences Mathématiques* **121** (1997), 405-422.
- [15] Une identité en loi remarquable pour l'excursion brownienne normalisée. (avec L. Alili et M. Yor) *In: Exponential functionals and principal values related to Brownian motion, Biblioteca de la Revista Matematica Ibero-Americana* (1997).
- [16] Some Brownian functionals and their laws (avec M. Yor), *Annals of Probability* **25** (1997), 1011-1058 .
- [17] Intégrales stochastiques de processus anticipants et projections duales prévisibles (avec M. Yor) *Publicaciones Matemáticas* **43** (1999), 281-301.
- [18] The joint law of the last zeros of Brownian motion and of its Lévy transform (avec Z. Shi et M. Yor), *Ergodic Theory and Dynamical systems* **20** (2000), 709-725.
- [19] Some measure valued Markov processes attached to occupation times of Brownian motion (avec M. Yor), *Bernoulli* **6(1)** (2000), 63-72.
- [20] Affine random equations and the stable (1/2) distribution (avec R. Ghomrasni et M. Yor). *Studia Sci. Math. Hungarica* **36** (2000), 387-405.
- [21] On positive and negative moments of the integral of geometric Brownian motions (avec H. Matsumoto et M. Yor). *Stat. Prob. Letters* **49** (2000), 45-52.

- [22] On striking identities about exponential functionals of the Brownian bridge and Brownian motion (avec H. Matsumoto et M. Yor). *Periodica Math. Hungarica* **41** (2000), 103-119.
- [23] On certain Markov processes attached to exponential functionals of Brownian motion ; application to Asian options (avec R. Ghomrasni et M. Yor). *Revista Mat. Iberoamericana* **17** (2001), 179-193.
- [24] Some remarks about the identity in law for the Bessel bridge $\int_0^1 \frac{ds}{r(s)} \stackrel{(law)}{=} 2 \sup_{s \leq t} r(s)$. *Studia Sci. Math. Hungarica* **37** (2001), 131-144.
- [25] The Lévy area process for the free Brownian motion. (avec M. Capitaine) *J. Funct. Anal.* **179** (2001), 153-169.
- [26] The law of geometric Brownian motion and its integral, revisited; application to conditional moments (avec H. Matsumoto et M. Yor). In: *Mathematical Finance, Bachelier Congress*, Springer Finance (2002).
- [27] Some absolute continuity relationships for certain anticipative transformations of geometric Brownian motions (avec H. Matsumoto et M. Yor). *Publ. RIMS Kyoto Univ.* **37** (2001), 295- 326.
- [28] Penalization of the Wiener measure and principal values (avec Y. Hu). *Séminaire de Probabilités XXXVI* (2003) 251-269.
- [29] Stochastic integration with respect to q Brownian motion. *Prob. Theory and Related Fields* **125** (2003) 77-95.
- [30] Large deviations for squares of Bessel and Ornstein-Uhlenbeck processes (avec A. Rouault, M. Yor, M. Zani). *Prob. Theory and Related Fields* **129** (2004), 261–289.
- [31] Some properties of the Wishart processes and a matrix extension of the Hartman-Watson laws. (avec Y. Doumerc, H. Matsumoto, M. Yor) *Publ. Res. Inst. Math. Sci.* **40** (2004), no. 4, 1385–1412.
- [32] Free Wishart processes. (avec M. Capitaine). *J. Theoret. Probab.* **18** (2005) 413–438.

- [33] Some explicit Krein representations of certain subordinators, including the Gamma process. (avec M. Yor). *Publ. RIMS, Kyoto University* **42** (2006) 879–895.
- [34] Strong asymptotic freeness for Wigner and Wishart matrices. (avec M. Capitaine). *Indiana Univ. Math. J.* **56** (2007) 767–804.
- [35] Further examples of explicit Krein representations of certain subordinators (avec M. Yor). *Publ. RIMS, Kyoto University* **43** (2007) 315–328.
- [36] On constants related to the choice of the local time at 0, and the corresponding Itô measure for Bessel processes with dimension $d = 2(1 - \alpha)$, $0 < \alpha < 1$. (avec B. Roynette, P. Vallois et M. Yor). *Studia Sci. Math. Hungarica* **45** (2008) 207–221.
- [37] Large deviations for Wishart processes. *Probability and Mathematical Statistics* **28** (2008) 325–343.
- [38] The largest eigenvalues of finite rank deformation of large Wigner matrices: convergence and non-universality of the fluctuations (avec M. Capitaine and D. Féral), *Annals of Probability* **37** (2009) 1–47.
- [39] Central limit theorems for eigenvalues of deformations of Wigner matrices. (avec M. Capitaine and D. Féral) . A Paraître aux Annales de l’IHP (2011).
- [40] A sequence of Albin type continuous martingales with Brownian marginals. (avec D. Baker et M. Yor). *Séminaire de Probabilités XLIII*, L. Notes in Math. 2006, Springer (2010), 441–450.

Prépublications

- [P1] Free convolution with a semi-circular distribution and eigenvalues of spiked deformations of Wigner matrices. (avec Mireille Capitaine, Delphine Féral, Maxime Février). (2010) arXiv:1006.3684
- [P2] Truncations of Haar unitary matrices, traces and bivariate Brownian bridge. (avec A. Rouault) (2010) arXiv:1007.1366.
- [P3] Large deviations for the largest eigenvalue of a Hermitian Brownian motion (avec M. Maïda). Preprint