

Krzysztof Bogdan

Politechnika Wrocławska, Wydział Matematyki

Zastosowania wzoru Mecke–Palma

Omówimy wzory na wartość oczekiwaną iterowanych sum względem losowych miar Poissona, które rozszerzają wzór Mecke–Palma. Omówimy ich związki z kombinatoryką i zastosowania do całek wykładniczych dla procesów Lévy’ego.

Applications of the Mecke–Palm formula

We will give expectations of iterated summations with respect to Poisson random measures, which generalize Mecke–Palm formula. We will discuss connections to combinatorics and applications to exponential integrals of Lévy processes.