

Shiqi Song

Statut Docteur du Laboratoire de Probabilités Paris 6, habilité à diriger les recherches, professeur des universités à l'Université d'Evry Val Essonne.

Domaines de recherche Théorie générale des processus, grossissement de filtrations, analyse stochastique, processus de Markov et formes de Dirichlet, mathématiques financières.

Liste de publications

1. **Song S.** Quelques conditions suffisantes pour qu'une semi-martingale soit une quasi-martingale, *Stochastics*, Vol.16, p.97-109, 1986.
2. **Song S.** et Yor M. Inégalités pour les processus self-similaires arrêtés à un temps quelconque, *Séminaire de Probabilités XXI, Lecture Notes in Mathematics*, Springer-Verlag, Berlin-Heidelberg-New York, 1987.
3. **Song S.** Admissible vectors and their associated Dirichlet forms, *Potential Analysis* 1, p.319-336, 1992.
4. **Song S.** An infinite dimensional analogue of the Albeverio-Röckner's theorem on Fukushima's conjecture, *Acta Math. Appl. Sinica*, Vol.9, No2, p.115-124, 1993.
5. **Song S.** Compactifications of Banach spaces and construction of Diffusion processes, *Acta Math. Appl. Sinica*, Vol.10, No3, p.225-232, 1994.
6. **Song S.** A study on Markovian maximality, change of probability and regularity, *Potential Analysis*, 3-4, p.391-422, 1994.
7. **Song S.** Some calculations on the conditional densities of well-admissible measures on linear spaces, *Potential Analysis* 3-1, p.159-170, 1994.
8. Donati C., **Song S.**, Yor M. On symmetric stable random variables and matrix transposition, *Ann. I. H. P.* 30-3, p.397-413, 1994.
9. Donati C., **Song S.**, Yor M. Symmetric stable processes, Fubini's theorem, and some extensions of the Ciesielski-Taylor identities in law, *Stochastics and stochastic reports*, 50, p.1-33, 1994.
10. **Song S.** Une propriété de l'espérance conditionnelle dans l'espace produit de Wiener, *Bull. Sci. Math.*, 118, p.167-176, 1994.
11. **Song S.** Processus d'Ornstein-Uhlenbeck et ensembles $W_{2,2}$ -polaires, *Potential analysis*, Vol.2, n°2, p.171-186, 1993.
12. Albeverio S., **Song S.** Closability and resolvent of Dirichlet forms perturbed by jumps, *Potential Analysis* 2, p.115-130, 1993.
13. **Song S.** Inégalités relatives aux processus d'Ornstein-Uhlenbeck à n-paramètres et capacité gaussienne $c_{n,2}$, 1993, *Séminaire de Probabilités XXVII, Lecture Notes in Mathematics*, 1557, Springer-Verlag, 1993.

14. **Song S.** Markov uniqueness and essential self-adjointness of perturbed Ornstein-Uhlenbeck operators, *Osaka Journal of Mathematics* 32, p.823-832, 1995.
15. Hirsch F., **Song S.** Inequalities for Bochner's subordinates of two-parameter symmetric Markov processes, *Ann. Inst. Henri Poincaré* Vol.32, n°5, p.589-600 1996.
16. Hirsch F., **Song S.** Markov properties of multiparameter processes and capacities, *P.T.R.F.*, 103-1, p.45-71, 1995.
17. Hirsch F., **Song S.** Symmetric Skorohod topology on n-variable functions and hierarchical Markov properties of n-parameter processes, *P.T.R.F.*, 103-1, p.25-43, 1995.
18. Hirsch F., **Song S.** Criteria of positivity for the density of the law of a Wiener functional, *Bull. Sci. Math.*, vol.121, p.261-273, 1997.
19. Hirsch F., **Song S.** Propriétés de Markov des processus à plusieurs paramètres et capacités, *C.R.A.S., Série I*, t. 319, p.483-488, 1994.
20. Hirsch F., **Song S.** Une inégalité maximale pour certains processus de Markov à plusieurs paramètres (I), *C.R.A.S., Série I*, t. 320, p.719-722, 1995.
21. Hirsch F., **Song S.** Une inégalité maximale pour certains processus de Markov à plusieurs paramètres (II), *C.R.A.S., Série I*, t. 320, p.867-870, 1995.
22. **Song S.** Inégalité de Meyer pour le semigroupe d'Ornstein-Uhlenbeck généralisé, *C.R.A.S., Série I*, t. 320, p.993-996, 1995.
23. **Song S.** C-semigroups on Banach spaces and functional inequalities, *Lecture Notes in Math.* 1613, *Séminaire de Probabilités XXIX*, p.297-326, 1995.
24. Hirsch, F., **Song S.** Sur l'ensemble de stricte positivité de la densité de fonctionnelles de Wiener, *C.R. Acad. Sci. Paris*, t.322, Série I, p.481-484, 1996.
25. Hirsch F., **Song S.** Properties of the set of the strict positivity of the density of a regular Wiener functional, *Bull. Sci. Math.* vol.122, p1-15, 1998.
26. Barlow M., Emery M., Knight F., **Song S.**, Yor M. Autour d'un théorème de Tsirelson sur des filtrations browniennes et non-browniennes, *Séminaire de Probabilités XXXII*, edited by J. Azéma, M. Emery, M. Ledoux, M. Yor, *Lecture Notes in Mathematics* 1686, Springer 1997.
27. Hirsch. F, **Song S.** Multiparameter Markov processes and capacity, in *Stochastic Analysis, Random Fields and Applications*, Ascona, 1997.
28. **Song S.** Two-parameter Bessel processes, *Stochastic Processes and Applications* 83 p.187-209. 1999.
29. Hirsch F., **Song S.** Markovian uniqueness on Bessel space, in *Forum Math.* 13, 287-322, de Gruyter 2001.
30. Loukianova D., Loukianov O., **Song S.** Poincaré inequality and exponential integrability of hitting times for a linear diffusion, *Ann. Inst. H. Poincaré Probab. Statist.* vol.47, Number 3, p.679-698 2011.
31. Jeanblanc M., **Song S.** An explicit model of default time with given survival probability. *Stochastic Processes and their Applications.* Vol.121, Issue 8, p.1678-1704, 2011.

32. Jeanblanc M., **Song S.** Random times with given survival probability and their \mathbb{F} -martingale decomposition formula. *Stochastic Processes and their Applications*. Vol.121, Issue 6, p.1389-1410, 2011.
33. Jeanblanc M., Fontana C., **Song S.** On arbitrages arising with honest times. *Finance and Stochastics* 18 p.515-543 2014.
34. Jeanblanc M., **Song S.** Martingale representation property in progressively enlarged filtrations. *Stochastic Processes and their Applications* **125**(11) 4242-4271 2015.
35. **Song S.** Optional splitting formula in a progressively enlarged filtration. *ESAIM Probability and Statistics* **18** 829-853 2014.
36. **Song S.** Drift operator in a market affected by an expansion of information flow. *Stochastic Processes and Applications* **126**(8) 2297-2322 2016.
37. Crepey S., **Song S.** BSDEs of counterparty risk. *Stochastic Processes and their Applications* **125**(8) 3023-3052 2015.
38. **Song S.** Random time with differentiable conditional distribution function. *Theory of Probability and its Applications* 2016.
39. Crepey S., **Song S.** Counterparty risk and funding : Immersion and beyond. *Finance and Stochastics* Forthcoming 2016.
40. Kabanov Y., Kardaras C., **Song S.** No arbitrage and local martingale deflators. *Finance and Stochastics* **20** 1097-1108 2016.
41. Crepey S., **Song S.** Invariant times. *The Annals of Probability* **45**(6B) 4632-4674 2017.
42. Jeanblanc M., Li L., **Song S.** An enlargement of filtration formula with applications to multiple non-ordered default times *Finance and Stochastics* **22**(1) 205-240 2018.