

FONCTION GÉNÉRATRICE (C5)

(07 / 06 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

Plusieurs procédés permettent de transformer une **loi de probabilité** afin d'en déduire des **caractéristiques**.

(i) Parmi ces procédés figurent divers types de **fonctions génératrices**, qui permettent de définir des **moments**, des **probabilités** ou des **covariances**, eg :

(a) la **fonction génératrice des moments algébriques**, simplement appelée **fonction génératrice** (fg) ;

(b) la **fonction génératrice des moments factoriels** ;

(c) la **fonction génératrice des probabilités** (ou des masses ponctuelles) associées aux valeurs d'une **variable discrète** ;

(d) la **fonction génératrice des autocovariances** d'un **processus stationnaire en covariance**.

(ii) Une transformation du type précédent admet, le plus souvent, une transformation inverse définissant une **formule d'inversion**, similaire à celle d'une **fonction caractéristique**.