

## SEMINAIRE DE PROBABILITES XII

## TABLE DES MATIERES

## PREMIERE PARTIE : MARTINGALES ET INTEGRALES STOCHASTIQUES

|  |     |
|--|-----|
| M. PRATELLI. Une version probabiliste d'un théorème d'interpolation de G. Stampacchia .....                                | 1   |
| C. STRICKER. Une remarque sur les changements de temps et les martingales locales .....                                    | 20  |
| J. JACOD. Projection prévisible et décomposition multiplicative d'une semi-martingale positive .....                       | 22  |
| J. MEMIN. Décompositions multiplicatives de semimartingales exponentielles et applications .....                           | 35  |
| N. KAZAMAKI. A remark on a problem of Girsanov .....   | 47  |
| M. GARCIA, P. MAILLARD, Y. PELTRAUT. Une martingale de saut multiplicatif donné .....                                      | 51  |
| E. LENGLART. Sur la localisation des intégrales stochastiques ....   | 53  |
| P.A. MEYER. Sur un théorème de J. Jacod .....  | 57  |
| M. YOR. Grossissement d'une filtration et semi-martingales : théorèmes généraux .....                                      | 61  |
| C. DELLACHERIE et P.A. MEYER. A propos du travail de Yor sur le grossissement des tribus .....                             | 70  |
| T. JEULIN et M. YOR. Grossissement d'une filtration et semi-martingales : Formules explicites .....                        | 78  |
| C. DELLACHERIE, P.A. MEYER et M. YOR. Sur certaines propriétés des espaces de Banach $H^1$ et BMO .....                    | 98  |
| T. YAMADA. Sur une construction des solutions d'équations différentielles stochastiques dans le cas non-lipschitzien ..... | 114 |
| C.S. CHOU. Extension au cas continu d'un théorème de Dubins ....   | 132 |
| D. LEPINGLE. Une inégalité de martingales .....  | 134 |
| D. LEPINGLE. Sur certains commutateurs de la théorie des martingales .....   | 138 |
| D. LEPINGLE. Sur le comportement asymptotique des martingales locales .....  | 148 |

|  |     |
|--|-----|
| R. CAIROLI. Une représentation intégrale pour les martingales fortes .....                                 | 162 |
| C. METRAUX. Quelques inégalités pour martingales à paramètre bidimensionnel .....                          | 170 |
| J.M. BISMUT. Contrôle des systèmes linéaires quadratiques : applications de l'intégrale stochastique ..... | 180 |
| M. YOR. Sous-espaces denses dans $L^1$ ou $H^1$ et représentation des martingales .....                    | 265 |
| ( avec J. de SAM LAZARO pour l'appendice )   |     |

## DEUXIEME PARTIE

|  |     |
|--|-----|
| D. WILLIAMS. The Q-Matrix problem 3 : The Lévy-Kernel problem for chains .....   | 310 |
| J. BRETAGNOLLE et C. HUBER. Lois empiriques et distance de Prokhorov .....   | 332 |
| J. BRETAGNOLLE et C. HUBER. Estimation des densités : Risque minimax .....   | 342 |
| C. STRICKER. Les ralentissements en théorie générale des processus .....   | 364 |
| J. BROSSARD. Comportement << non-tangential >> et comportement << brownien >> des fonctions harmoniques dans un demi-espace. Démonstration probabiliste d'un théorème de Calderon et Stein ..... | 378 |
| R. GETTOOR. Homogeneous potentials .....   | 398 |
| P.A. MEYER. Convergence faible et compacité des temps d'arrêt, d'après Baxter et Chacòn .....  | 411 |
| C. DELLACHERIE. Convergence en probabilité et topologie de Baxter-Chacòn .....   | 424 |
| C. DELLACHERIE et P.A. MEYER. Construction d'un processus prévisible ayant une valeur donnée en un temps d'arrêt .....   | 425 |
| F.B. KNIGHT. On the sojourn times of killed brownian motion .....  | 428 |
| J.C. TAYLOR. Some remarks on Malliavin's comparison lemma and related topics .....   | 446 |
| M.A. MAINGUENEAU. Temps d'arrêt optimaux et théorie générale .....   | 457 |
| J. SAINT RAYMOND. Quelques remarques sur un article de M.D. Donsker et S.R.S. Varadhan .....   | 468 |

|   |     |
|---|-----|
| M. YOR et P.A. MEYER. Sur l'extension d'un théorème de Doob à un noyau $\sigma$ -fini, d'après G. Mokobodzki .....              | 482 |
| G. MOKOBODZKI. Domination d'une mesure par une capacité .....   | 489 |
| G. MOKOBODZKI. Ensembles à coupes dénombrables et capacités dominées par une mesure .....                                       | 491 |
| C. DELLACHERIE. Appendice à l'exposé de Mokobodzki .....  | 509 |
| C. DELLACHERIE. Sur l'existence de certains ess.inf et ess.sup de familles de processus mesurables .....                        | 512 |
| C. DELLACHERIE. Supports optionnels et prévisibles d'une P-mesure et applications .....   | 515 |
| C. DELLACHERIE. Erratum et addendum à << les dérivations en théorie descriptive des ensembles et le théorème de la borne >>.... | 523 |
| G. HILLARD. Exemples de normes en théorie descriptive des ensembles .....   | 524 |
| C. DELLACHERIE et G. MOKOBODZKI. Deux propriétés des ensembles minces (abstraits) .....   | 564 |
| C. NANOPoulos et Ph. NOBELIS. Régularité et propriétés limites des fonctions aléatoires .....                                   | 567 |
| X. FERNIQUE. Caractérisation de processus à trajectoires majorées ou continues .....  | 691 |
| C. DELLACHERIE. Théorie unifiée des capacités et des ensembles analytiques .....  | 707 |
| CORRECTIONS AU VOLUME XI (ET AUTRES) DU SEMINAIRE .....   | 739 |

#### EXPOSES SUPPLEMENTAIRES

|   |     |
|---|-----|
| C. DELLACHERIE. Quelques applications du lemme de Borel-Cantelli à la théorie des semimartingales .....   | 742 |
| C. DELLACHERIE. Quelques exemples familiers, en probabilités, d'ensembles analytiques non boréliens ..... | 746 |
| P.A. MEYER. Inégalités de normes pour les intégrales stochastiques .....                                  | 757 |
| P.A. MEYER. La formule d'Ito pour le mouvement brownien, d'après Brosamler .....                          | 763 |

|  |     |
|--|-----|
| P.A. MEYER. Sur le lemme de La Vallée Poussin et un théorème de Bismut ..... | 770 |
| P.A. MEYER. Martingales locales fonctionnelles additives I .....             | 775 |
| P.A. MEYER. Martingales locales fonctionnelles additives II .....            | 786 |
| G. LETTA. Un système de notations pour les processus de Markov .             | 804 |