

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-tangentiel >> 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 Chacón	411
C. DELLACHERIE. Convergence en probabilité et topologie de Baxter-Chacón	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 σ -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