

Lecture Notes in Mathematics

1626

Editors:

A. Dold, Heidelberg

F. Takens, Groningen

Subseries:

Institut de Mathématiques, Université de Strasbourg

Adviser: J.-L. Loday

Springer

Berlin

Heidelberg

New York

Barcelona

Budapest

Hong Kong

London

Milan

Paris

Santa Clara

Singapore

Tokyo

J. Azéma M. Emery M. Yor (Eds.)

Séminaire de Probabilités XXX



Springer

Editors

Jacques Azéma
Marc Yor
Laboratoire de Probabilités
Université Pierre et Marie Curie
Tour 56, 3ème étage
4, Place Jussieu
F-75252 Paris, France

Michel Emery
Institut de Recherche Mathématique Avancée
Université Louis Pasteur
7, rue René Descartes
F-67084 Strasbourg, France

Cataloging-in-Publication Data applied for

Die Deutsche Bibliothek - CIP-Einheitsaufnahme

Séminaire de probabilités ... - Berlin ; Heidelberg ; New York
; ; Barcelona ; Budapest ; Hong Kong ; London ; Milan ; Paris
; Tokyo : Springer.
ISSN 0720-8766

30 (1996)
(Lecture notes in mathematics ; Vol. 1626)
ISBN 3-540-61336-6 (Berlin ...)
NE: GT

Mathematics Subject Classification (1991): 60GXX, 60HXX, 60JXX

ISSN 0075-8434

ISBN 3-540-61336-6 Springer-Verlag Berlin Heidelberg New York

This work is subject to copyright. All rights are reserved, whether the whole or part of the material is concerned, specifically the rights of translation, reprinting, re-use of illustrations, recitation, broadcasting, reproduction on microfilms or in any other way, and storage in data banks. Duplication of this publication or parts thereof is permitted only under the provisions of the German Copyright Law of September 9, 1965, in its current version, and permission for use must always be obtained from Springer-Verlag. Violations are liable for prosecution under the German Copyright Law.

© Springer-Verlag Berlin Heidelberg 1996
Printed in Germany

Typesetting: Camera-ready T_EX output by the authors
SPIN: 10479748 46/3142-543210 - Printed on acid-free paper

Le "Séminaire" a 30 ans, un âge où l'on se risque à dévoiler à un père, ou à un oncle bienveillant, un peu de l'admiration qu'on leur porte.

Au nom de tous leurs élèves, de cette "école française de probabilités" qu'ils ont créée et animée, nous dédions ce volume à

Paul-André MEYER et Jacques NEVEU.

La rédaction,
J. Azéma, M. Emery, M. Yor

SEMINAIRE DE PROBABILITES XXX

TABLE DES MATIERES

<u>S.D. CHATTERJI</u> : Remarques sur l'intégrale de Riemann généralisée.	1
<u>T. CHOULLI, C. STRICKER</u> : Deux applications de la décomposition de Galtchouk - Kunita - Watanabe.	12
<u>C. COCOZZA-THIVENT, M. ROUSSIGNOL</u> : Comparaison des lois stationnaire et quasi-stationnaire d'un processus de Markov et application à la fiabilité.	24
<u>P. JAGERS, O. NERMAN</u> : The asymptotic composition of supercritical, multitype branching populations.	40
<u>C. KIPNIS, E.SAADA</u> : Un lien entre réseaux de neurones et systèmes de particules : un modèle de rétinitopie.	55
<u>R. LEANDRE</u> : Cohomologie de Bismut - Nualart - Pardoux et cohomologie de Hochschild entière.	68
<u>J. de SAM LAZARO</u> : Un contre-exemple touchant à l'indépendance.	100
<u>J.A. YAN</u> : An asymptotic evaluation of heat kernel for short time.	104
<u>W. ZHENG</u> : Meyer's topology and Brownian motion in a composite medium.	108
<u>W. von WALDENFELS</u> : Continuous Maassen kernels and the inverse oscillator.	117
<u>M. ECHERBAULT</u> : Sur le modèle d'Heisenberg.	162
<u>D. BAKRY, M. ECHERBAULT</u> : Sur les inégalités GKS.	178
<u>SHI ZHAN</u> : How long does it take a transient Bessel process to reach its future infimum ?	207

VIII

<u>Y. HU</u> : Strong and weak order of time discretization schemes of stochastic differential equations.	218
<u>C. RAINER</u> : Projection d'une diffusion sur sa filtration lente.	228
<u>J. AZEMA, C. RAINER, M. YOR</u> : Une propriété des martingales pures.	243
<u>Ch. LEURIDAN</u> : Une démonstration élémentaire d'une identité de Biane et Yor.	255
<u>B. RAJEEV</u> : First order calculus and last entrance times.	261
<u>P. CATTIAUX, C. LEONARD</u> : Minimization of the Kullback information for some Markov processes.	288
<u>J. AZEMA, Th. JEULIN, F.B. KNIGHT, G. MOKOBODZKI, M. YOR</u> : Sur les processus croissants de type injectif.	312
<u>W. SCHACHERMAYER</u> : A characterization of the closure of H^{∞} in BMO.	344
<u>P. GRANDITS</u> : On a conjecture of Kazamaki.	357
<u>J. BERTOIN, Z. SHI</u> : Hirsch's Integral Test for the Iterated Brownian Motion.	361
<u>Corrections aux volumes antérieurs</u> :	
<u>L. SCHWARTZ</u> : Rectifications à un article antérieur. (Sém. XXVIII).	369
<u>Table générale des exposés du Séminaire de Probabilités</u> (Volumes XXVI à XXX).	371