

ANNALES SCIENTIFIQUES
DE L'UNIVERSITÉ DE CLERMONT-FERRAND 2
Série Mathématiques

M. EMERY

Annoncabilité des temps prévisibles

Annales scientifiques de l'Université de Clermont-Ferrand 2, tome 69, série *Mathématiques*, n° 19 (1981), p. 35

<http://www.numdam.org/item?id=ASCFM_1981__69_19_35_0>

© Université de Clermont-Ferrand 2, 1981, tous droits réservés.

L'accès aux archives de la revue « *Annales scientifiques de l'Université de Clermont-Ferrand 2* » implique l'accord avec les conditions générales d'utilisation (<http://www.numdam.org/conditions>). Toute utilisation commerciale ou impression systématique est constitutive d'une infraction pénale. Toute copie ou impression de ce fichier doit contenir la présente mention de copyright.

NUMDAM

Article numérisé dans le cadre du programme
Numérisation de documents anciens mathématiques
<http://www.numdam.org/>

ANNONCABILITE DES TEMPS PREVISIBLES

M. EMERY

Université de Strasbourg

L'exposé présente deux articles à paraître au Séminaire de Probabilités XIV, qui précisent le théorème IV 77 du livre Probabilités et Potentiel de Dellacherie et Meyer ; en voici les résultats :

1) Sous les conditions habituelles, si T est un temps d'arrêt prévisible strictement positif, il existe un processus A continu, strictement croissant et adapté, tel que $A_0 = 0$ et $A_T = 1$. En d'autres termes, l'intervalle stochastique $[[0, T[[$ est isomorphe, par changement de temps, à $[[0, 1[[$ (ou encore à $\mathbb{R}_+ \times \Omega$).

2) En revanche, sur un espace mesurable Ω muni d'une filtration continue à droite $(\mathbb{F}_t)_{t \geq 0}$, mais sur lequel on ne se donne pas de probabilité, il peut exister

a) un temps d'arrêt T prévisible (i.e. tel que son graphe soit prévisible), mais qui n'est la limite d'aucune suite strictement croissante de temps d'arrêt ;

b) un temps d'arrêt T pour lequel de telles suites existent (T est donc prévisible), mais ne sont jamais constituées de temps prévisibles.

IRMA (L.A. au C.N.R.S.)
7 rue René Descartes
67084 STRASBOURG Cedex