

SÉMINAIRE DE PROBABILITÉS (STRASBOURG)

PAUL-ANDRÉ MEYER

**Corrections : « Flot d'une équation différentielle
stochastique »**

Séminaire de probabilités (Strasbourg), tome 16 (1982), p. 623

http://www.numdam.org/item?id=SPS_1982__16__623_1

© Springer-Verlag, Berlin Heidelberg New York, 1982, tous droits réservés.

L'accès aux archives du séminaire de probabilités (Strasbourg) (<http://portail.mathdoc.fr/SemProba/>) 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/>

Correction au Séminaire XV. H. Perez Bercoff m'a signalé une erreur, dont je suis responsable (ayant imaginé cette << simplification >> à l'argument classique de Doob) dans le travail de R. Sidibé, p. 635, l. 18. L'argument << par convergence uniforme pour tout λ réel >> ne s'applique pas, car on ignore encore si la fonction $X(\omega)$ est p.s. bornée. Voici la vraie démonstration. Soit H_t^λ la martingale $\mathbb{R}(e^{i\lambda X_t}/\varphi_t(\lambda))$, et soit $M_\lambda([a,b],t,.)$ le nombre de ses montées sur $[a,b]$, aux points rationnels de l'intervalle $[0,t]$. D'après l'inégalité de Doob, $\int E[M_\lambda]d\lambda < \infty$ pour tout intervalle borné I. D'après Fubini, $M_\lambda([a,b],t,.) < \infty$ pour presque tout λ , d'où l'on déduit que pour presque tout ω , $e^{i\lambda X_t(\omega)}$ a des limites le long des rationnels pour presque tout λ . Cela suffit à justifier l'argument suivant par Riemann-Lebesgue, et le théorème.

(P.A. Meyer).

Sém. XV, p. 116. Une référence existe (communiquée par W. Darling, que je remercie) : H. TOTOKI. A Method of construction of measures in function space and its applications to stochastic processes. Mem. Fac. Sci. Kyushu Univ. 15, 1961, p. 178-190.