

SÉMINAIRE DE PROBABILITÉS (STRASBOURG)

ROLANDO REBOLLEDO

**Corrections : « Décomposition des martingales
locales et raréfaction des sauts »**

Séminaire de probabilités (Strasbourg), tome 14 (1980), p. 255

http://www.numdam.org/item?id=SPS_1980__14__255_0

© Springer-Verlag, Berlin Heidelberg New York, 1980, 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/>

CORRECTIONS A :
 DECOMPOSITION DE MARTINGALES LOCALES
 ET RAREFACTION DES SAUTS.

Rolando REBOLLEDO.

Nous avons relevé certaines inexactitudes dans l'article

[1] paru au Seminaire de Probabilités n° XIII :

1. Lemme 2, page 140, partie 1), Il est dit que $\underline{M}^\varepsilon$ et \overline{M}^ε sont orthogonales, ce qui est faux si M n'est pas quasi-continue à gauche.

Cependant, la relation de domination (1) est juste.

Par ailleurs, la relation de domination (4) doit être remplacée

par

$$(4) \quad \langle \underline{M}^\varepsilon; \overline{M}^\varepsilon \rangle^* \leq \overline{\langle \underline{M}^\varepsilon, \overline{M}^\varepsilon \rangle^*} \leq 4\varepsilon \tilde{\alpha}(M) \quad (\text{c.f. [2], 1.1.3})$$

2. La condition de raréfaction asymptotique des sauts ⁽¹⁾ (page 143)

doit être remplacée par

$$(1) \quad \langle \overline{M}_n^\varepsilon, \overline{M}_n^\varepsilon \rangle(t) + \overline{\langle \underline{M}_n^\varepsilon, \overline{M}_n^\varepsilon \rangle^*}(t) \xrightarrow[n \uparrow 0]{\mathbb{P}} 0 \text{ pour tout}$$

$$t \in \mathbb{R}_+, \text{ tout } \varepsilon > 0.$$

Avec cette modification, le lemme 5 reste vrai. (C.f. [2], 11.3.15)

[1] REBOLLEDO, R. Décomposition de Martingales locales et Raréfaction des sauts. Sem. de Proba. XIII, Lect. Notes in Maths. 721 (1978), 138-146.

[2] REBOLLEDO, R. La Méthode de Martingales appliquée à l'étude de la convergence en Loi de Processus. Rapport U. de Reims (1978), à paraître aux Mémoires de la S.M.F.

Faculté des Sciences
 Département de Mathématiques
 Parc Valrose

06034 - NICE CEDEX