

SÉMINAIRE DE PROBABILITÉS (STRASBOURG)

CATHERINE RAINER

Errata : « Projection d'une diffusion sur sa filtration lente »

Séminaire de probabilités (Strasbourg), tome 31 (1997), p. 329

http://www.numdam.org/item?id=SPS_1997__31__329_0

© Springer-Verlag, Berlin Heidelberg New York, 1997, 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/>

Errata : Projection d'une diffusion réelle sur sa filtration lente.

Catherine RAINER

Laboratoire de Probabilités, Université Paris VI, tour 56, 3ème étage,
4, place Jussieu, Paris 75252 Cedex 05.

Une erreur gênante nous a échappé dans la formule de la 14ème ligne de l'introduction, et nous profitons de la rectification pour ajouter à sa suite une remarque utile. A la fin du paragraphe d'introduction, on doit donc lire :

...Dans le cas général, on montrera que

$${}^{\circ}X_t = \frac{1}{2} \left(\frac{1_{\{X_t > 0\}}}{N_+(]t - G_t, +\infty])} - \frac{1_{\{X_t < 0\}}}{N_-(]t - G_t, +\infty])} \right),$$

où N_+ resp. (N_-) est la mesure de Lévy des excursions positives (resp. négatives) de (X_t) en dehors de zéro.

Remarque : Lorsque (X_t) est symétrique par rapport à zéro, les deux mesures de Lévy sont égales à une demi fois la mesure de Lévy des zéros de (X_t) , \bar{N} , et on a la formule encore plus simple suivante :

$${}^{\circ}X_t = \frac{\text{sgn}X_t}{\bar{N}(]t - G_t, +\infty])}.$$

