Paul-André Meyer

Correction : « Quelques résultats de « mécanique stochastique » »

Séminaire de probabilités (Strasbourg), tome 20 (1986), p. 614
<http://www.numdam.org/item?id=SPS_1986__20__614_0>

Correction au Sém. XVIII, p. 235. C. Stricker nous a signalé que l'on n'a pas le droit d'invoquer , ligne 13, le théorème de Kazamaki, la fonction $|z|^2$ n'ayant pas (contrairement à ce qui est affirmé !) un 1-potentiel newtonien borné. Cependant, on a en posant $\theta=-\lambda/c<0$

$$L_t=\theta\int_0^t X_s dB_s = \theta\int_0^t X_s d(X_s - \frac{c}{X_s}s) = \frac{\theta}{2}[X_t^2-x^2-3ct]$$

$$M_t = \exp[\ \frac{\theta}{2}(X_t^2-x^2-3ct) - \frac{\theta^2}{2}\int_0^t X_s^2 ds]$$

et comme θ est négatif , M_t est une v.a. bornée, et l'on a bien une vraie martingale. Nous devons cette remarque à M. Yor, qui nous a montré aussi comment on peut traiter le cas (plus difficile) où θ serait positif.