

SÉMINAIRE DE PROBABILITÉS (STRASBOURG)

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

© Springer-Verlag, Berlin Heidelberg New York, 1986, 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 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 $\theta = -\lambda/c < 0$

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

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

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.