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) , $\overline{N}$, et on a la formule encore plus simple suivante :

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