

## ESPACE FILTRÉ (C, F)

(21 / 05 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

Soit  $(\Omega, \mathcal{F})$  un **espace probabilisable**,  $(T, \leq)$  un espace (totale)ment ordonné (cf **relation d'ordre**) et  $\mathcal{F} = (\mathcal{F}_t)_{t \in T}$  une **filtration** sur  $\mathcal{F}$ .

On dit que le triplet  $(\Omega, \mathcal{F}, \mathcal{F})$  définit un **espace filtré** (cf **processus stochastique**).