

ESPACE FILTRÉ (C, F)

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

Soit (Ω, \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**).