

PROBLÈME DE MARTINGALE (N1, N2)

(11 / 06 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

Soit (Ω, \mathcal{F}) un **espace probabilisable**, $T \subset \mathbf{N}$ (resp $T \subset \mathbf{R}_+$) l'espace des **temps**, $\mathcal{F} = (\mathcal{F}_t)_{t \in T}$ une **filtration** sur Ω et $\Xi = \{X\}$ une **famille** de **processus stochastiques** $X = (X_t)_{t \in T}$ adaptés à \mathcal{F} (cf **processus adapté**).

Un **problème de martingale** consiste à déterminer l'ensemble \mathcal{P} des **probabilités** P définies sur \mathcal{F} tq, pour tout processus X (ie pour tout élément de Ξ), X soit une **martingale**.