

Martingales

Contexte

- L'espérance conditionnelle est une v.a. dont la valeur sur un élément de la sous-tribu s'interprète comme la moyenne de la v.a. initiale sur cet élément.

Méthode

Définitions et propriétés élémentaires

Résultats principaux

- calculs effectifs d'espérance et de loi conditionnelle
- Props sur l'uniforme intégrabilité
- Super cv dominée
- Lemme de Scheffé

Outils importants

Autres résultats