

Une  $g$ -mesure (ou chaîne d'ordre infini) est une généralisation naturelle d'une chaîne de Markov, dans laquelle une fonction  $g$  spécifie quelle portion du passé est nécessaire pour prédire le symbole suivant (pour une chaîne de Markov d'ordre un, il est nécessaire d'aller voir un pas dans le passé, pour une  $g$ -mesure, il se peut que le passé tout entier soit nécessaire).

L'existence de  $g$ -mesures non régulières sera discutée, c'est-à-dire quand la fonction  $g$  n'est pas nécessairement continue.