

大学院コア科目「確率論」レポート問題 No.2
提出は次回の講義 (4/26) の時間まで .

学籍番号 _____ 氏名 _____

ブラウン運動 $B(t)$ と任意の $t > 0$ に対して

$$\lim_{h \searrow 0} E \left(\frac{|B(t+h) - B(t)|^2}{h^2} \right)$$

を計算せよ . (実はブラウン運動は至るところ微分できない事が知られている)