

大学院コア科目「確率論」レポート問題 No.7
提出は次回の講義 (6/14) の時間まで .

学籍番号 _____ 氏名 _____

伊藤の公式を使って $B(t)^4$ を計算せよ . ただし $B(t)$ は (\mathcal{F}_t) -Brown 運動 .
(これは (\mathcal{F}_t) -劣マルチンゲールなので , 伊藤の公式により Doob-Meyer 分解
が自動的に出てくる)