

大学院コア科目「確率論」レポート問題 No.8
提出は次回の講義 (6/21) の時間まで .

学籍番号 _____ 氏名 _____

1. $X(t) = aB(t) - \mu t$ について $e^{X(t)}$ に対する伊藤の公式はどうなるか？
2. $e^{X(t)}$ が (\mathcal{F}_t) -マルチンゲールになるには μ をどう決めれば良いか？