

procesy stochastyczne
I rok matematyki II stopnia
praca domowa 2 - semestr zimowy 2015/2016
1 kwietnia 2016

1. zadanie 7 z listy 2 dr. J.Kotowicza.
2. zadanie 23 z listy 2 dr. J.Kotowicza.
3. zadanie 30 p.3) z listy dr. J.Kotowicza.
4. Niech $(M_n)_{n \in \mathbb{N}}$ będzie (\mathcal{F}_n) -martyngałem, ponadto niech τ będzie ograniczonym P -p.n. (\mathcal{F}_n) -momentem stopu. Pokazać, że wtedy zmienna losowa M_τ jest całkowalna.
5. Nierówność Dooba z wykładu z 18 marca 2016

uwaga:

- za każde zadanie można otrzymać maksymalnie po jednym punkcie;
- przewidziana jest punktacja: $0, \frac{1}{2}$ lub 1pkt;
- zadania można rozwiązywać w podzespołach dwuosobowych;

termin oddania pracy domowej: 14.04.2016;