

procesy stochastyczne
I rok matematyki II stopnia
praca domowa 3 - semestr zimowy 2015/2016
13 maja 2016

1. Zad 18/lista 4, dowieść warunków dostatecznych jednostajnej całkowalności.
2. Podać przykład procesu o funkcji kowariancji $K(t, s) = \min(t, s)$ i nie będącego stochastyczną modyfikacją procesu Wienera.
3. Udowodnić, że proces Wienera jest stochastycznie ciągły.

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: 1.06.2016;