

Corsi di Laurea Magistrale in Matematica, A.A. 2019-20
Calcolo stocastico e applicazioni (Docente: Bertini)
Esercizi settimanali

SETTIMANA 3

Esercizio 1. Dimostrare che, con probabilità uno, il moto browniano ha variazione infinita in ogni intervallo.

Esercizio 2. Esercizio 1.29 del libro di Liggett.

Esercizio 3. Sia B il moto browniano. Utilizzando Corollario A.28 del libro di Liggett, dimostrare che, con probabilità uno,

$$\overline{\lim}_{t \rightarrow +\infty} \frac{B_t}{\sqrt{t}} = +\infty$$

Esercizio 4. Esercizio 1.30 del libro di Liggett.

Esercizio 5. Esercizio 1.127 del libro di Liggett.