

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

SETTIMANA 4

Esercizio 1. Siano τ_1, τ_2 due tempi di arresto e $\mathcal{F}_{\tau_1}, \mathcal{F}_{\tau_2}$ le corrispondenti filtrazioni arrestate. Dimostrare che se $\tau_1 \leq \tau_2$ allora $\mathcal{F}_{\tau_1} \subset \mathcal{F}_{\tau_2}$.

Esercizio 2. Esercizio 1.53 del libro di Liggett.

Esercizio 3. Esercizio 1.82 del libro di Liggett.

Esercizio 4. Esercizio 1.83 del libro di Liggett.