

习题5

截止时间：12月13日

习题1. 课本[L] 5.8

习题2. 课本[L] 5.13

习题3. 课本[L] 8.1

习题4. 课本[L] 8.2

习题5. 课本[L] 8.6

习题6. 课本[L] 8.8 (补充定义当 $t = 0$ 时 $Y_t = 0$)

习题7. 课本[L] 8.10

习题8. 课本[Q] P104 2

习题9. 设 $\{X_t, t \geq 0\}$ 为标准Brown运动, 计算条件概率 $P\{X_2 > 0 | X_1 > 0\}$.
问: 事件 $\{X_2 > 0\}$ 和 $\{X_1 > 0\}$ 是否独立?