

Pénzügyi matematika

Házi feladatok III.

Határidő: 2020. október 19.

Az előadásjegyzet 4.1 fejezetének jelöléseit használjuk.

8. Igazoljuk, hogy

$$\lim_{a \rightarrow \pm\infty} \varphi(a) = \infty.$$

9. Legyen Z standard normális. Határozzuk meg $\mathbf{E}e^{tZ}$ momentumgeneráló függvényt!

10. Legyen $X \sim N(\mu, \sigma^2)$. Adjuk meg az ehhez a változóhoz konstruált mértéket!

11. Igazoljuk, hogy az a_n véletlen változó \mathcal{F}_{n-1} -mérhető!