

**A SZTOCHASZTIKUS FOLYAMATOK VIZSGÁN
MEGVÁLASZOLANDÓ KÉRDÉSEK.**

- 1.) Mi a Wiener folyamat definíciója? Hogy szól a funkcionális centrális határeloszlás-tétel?
- 2.) Mi egy valószínűségi változónak egy σ -algebra szerinti feltételes várható értéke?
- 3.) Hogy szól a Kolmogorov–Chapman azonosság?
- 4.) Mit nevezünk a Markov láncok elméletében osztálytulajdonságnak? Milyen eredményekről tanultunk ezzel kapcsolatban?
- 5.) Mi a születési és szünetelési és halálozási folyamat definíciója? Milyen módszereket tanultunk ezen modellek vizsgálatáról?
- 6.) Legyen $W(t)$, $t \geq 0$, egy Wiener folyamat. Mutassa meg, hogy a $Z(u) = e^{W(u)-u/2}$ sztochasztikus folyamat martingál.