

Kolokwium 2

Grupa B

Zadanie 1. Niech W^1, W^2 będą dwoma niezależnymi procesami Wienera i niech $\rho \in [0, 1]$. Określmy proces $X_t = \rho W_t^1 + \sqrt{1 - \rho^2} W_t^2$ dla dowolnego $t \geq 0$. Czy proces X jest procesem Wienera?