問題１

は正の定数，はブラウン運動とし，この方程式の解を求めよ．

1. を計算せよ
2. (1)の解を積分し，について積分することで方程式の解を求めよ．

両辺を0からまで積分し，

問題2

とする．

1. を求めよ．偏微分はとして表せ．
2. を求めよ

(1)で求めた結果と拡散項の期待値は0であることから，