

1. Hacer los ejercicios 2.2, 2.3, 2.6, 2.8, 2.10, 2.15(a), 2.16 del libro.

Segundo Lema de Wald. Sea T un tiempo de para para un Movimiento Browniano tal que $\mathbb{E}(T) < \infty$.
Entonces

$$\mathbb{E}[B(T)^2] = E[T].$$

2. ¿Es posible demostrar el Segundo Lema de Wald siguiendo los pasos de la demostración del Primer Lema de Wald? ¿Por qué?

*Entregar dos ejercicios a elección.

Fecha estimada de entrega: 17 de Mayo.