

## 15 確率過程の基礎

④ 独立定常増分過程

⑤ ブラウン運動

$$B_t \sim N(\mu t, \sigma^2 t)$$

○  
○  
○ $\int_{t_0}^{t_1} X_{t_1} - X_{t_0}$

ブラウン運動