02FDRAK1

1. Antag $g \in \mathcal{P}$ och

$$v(t,s) = e^{-r\tau} E\left[g(se^{(r-\frac{\sigma^2}{2})\tau+\sigma W(\tau)})\right]$$

där $\tau = T - t$. Visa att

$$v(t,s) = e^{-r\tau_*} E\left[v(t_*, se^{(r-\frac{\sigma^2}{2})\tau_*+\sigma W(\tau_*)})\right]$$

för $t \leq t_* \leq T$ där $\tau_* = t_* - t$. (Ledning: Om $G, G' \in N(0,1)$ är stokastiskt oberoende så gäller att $\sqrt{\tau_*}G + \sqrt{T-t_*}G' \in N(0,\tau)$.)

Kap1: Ö1, 2, 3, 4, 7, 8