

# Stochastische Prozesse

## Präsenzübung 6

Vorlesung: Otfried Gühne, Übung: Timo Simnacher (B-111, timo.simnacher@physik.uni-siegen.de)  
Vorlesung: Mi 16-18 Uhr (D-120), Übung: Fr 10-12 Uhr (D-115)

Bearbeitung am 22.11.2019.

### 1. Stochastische Integrale

Überlegen Sie sich, warum

$$\int_0^T \int_0^t f(s) dW(s) dt = \int_0^T \left[ \int_0^t f(s) ds \right] dW(t) \quad (1)$$

gilt.