

ABSTRAK

Integral terhadap proses Stokastik disebut Integral Stokastik. Untuk suatu fungsi $f \in L^2(M)$ yang terukur terhadap \mathcal{F}_t serta terdefinisi pada suatu interval berhingga maka didefinisikan Integral Stokastik terhadap Martingale - L^2 . Sedangkan apabila fungsi itu elemen dari $\mathcal{M}_2^v[0,T]$ yang juga terukur terhadap \mathcal{F}_t dan terdefinisi pada interval berhingga maka didefinisikan Integral Stokastik terhadap Wiener Martingale.