

ABSTRAK

Gerak Brown dengan mean μ dan variansi σ^2 adalah suatu proses stokastik $\{X_t; t \geq 0\}$, dengan $X_{t+s} - X_t$ merupakan penambahan - penambahan selama interval waktu $(t, t+s]$ untuk $s > 0$. Karena itu, $X_{t+s} - X_t$ adalah Gaussian dengan mean $\mu(s)$ dan variansi $\sigma^2(s)$, dan penambahan $X_{t+s} - X_t$ bebas dengan $\{X_u; 0 \leq u \leq t\}$.

Dengan pengulangan dan interpolasi linier pada interval waktu berhingga, yaitu $[0,1]$, diperoleh model dari suatu ukuran peluang P pada $(\Omega, \mathcal{F}) := (\mathbb{R}^{[0, \infty)}, \mathcal{B}(\mathbb{R}^{[0, \infty)}))$, sedemikian sehingga $B = \{B_t, \mathcal{F}_t^B; 0 \leq t < \infty\}$ adalah gerak Brown dimensi satu standar.

