

Homework 2

Alfredo Baione (s279328@studenti.polito.it)

11 febbraio 2021

Realizzato in collaborazione con Giulio Nenna (s245717), Andrea Sanna (s222975) e Ornella Elena Grassi (s290310)

Esercizio 1.

(1) Dato che sono apparsi 8 fiori tra le 9 e le 10 a.m.,

- la probabilità che 3 di questi siano apparsi tra le 9 e le 9:20 a.m. è

$$P\left(N\left(\frac{1}{3}\right) = 3 \mid N(1) = 8\right) = \binom{8}{3} \left(\frac{1}{3}\right)^3 \left(1 - \frac{1}{3}\right)^5 \sim 0.273;$$

- la probabilità che ne appaiano 13 tra le 9 a.m. e le 11 a.m. è

$$P(N(2) = 13 \mid N(1) = 8) = P(N(2) - N(1) = 5) = e^{-3} \frac{3^5}{5!} \sim 0.101.$$

(2) Si vuole calcolare la probabilità che tra le 9 a.m. e le 11 a.m. compaiano esattamente 3 fiori di tipo A, 2 di tipo B e nessuno di tipo C. Siano $N_i(t)$ con $i \in \{A, B, C\}$ i processi di Poisson ottenuti dal *thinning* del processo principale $N(t)$. Essi rappresentano quindi il numero di fiori di tipo i sbocciati entro l'istante t e sono indipendenti con rate λp_i . Si ottiene:

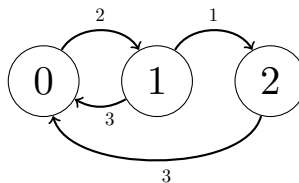
$$\begin{aligned} P(N_A(2) = 3, N_B(2) = 2, N_C(2) = 0) &= \\ P(N_A(2) = 3)P(N_B(2) = 2)P(N_C(2) = 0) &= \\ e^{-3\frac{1}{3}2} \frac{\left(3\frac{1}{3}2\right)^3}{3!} \cdot e^{-3\frac{1}{6}2} \frac{\left(3\frac{1}{6}2\right)^2}{2!} \cdot e^{-3\frac{1}{2}2} \frac{\left(3\frac{1}{2}2\right)^0}{0!} &= \\ e^{-2} \frac{8}{3!} \cdot e^{-1} \frac{1}{2!} \cdot e^{-3} &\sim 0.0016 \end{aligned}$$

- (3) Indicando con τ_1 il tempo in cui compare il primo fiore di tipo A, risulta che se $N_A(t) \sim \text{Poisson}(\lambda p_A = 1)$, allora $\tau_1 \sim \exp(1)$.
 Pertanto, condizionatamente al fatto che il primo fiore che compare è di tipo A, la probabilità che il tempo τ in cui ciò avviene sia $\leq \frac{1}{2}$ è

$$P\left(\tau_1 \leq \frac{1}{2}\right) = \int_0^{\frac{1}{2}} 1 \cdot e^{-1 \cdot x} dx = 1 - e^{-\frac{1}{2}} \sim 0.393.$$

Esercizio 2.

- (a) Il processo di costruzione e distruzione del castello di sabbia può essere modellato con una catena di Markov a tempo continuo siffatta:



$S = \{0, 1, 2\}$ è l'insieme degli stati associati ai seguenti rates di permanenza in ognuno di essi:

$$\begin{aligned}\lambda(0) &= 2, \\ \lambda(1) &= \left(\frac{1}{1 + \frac{1}{3}} \right) = \frac{3}{4}, \\ \lambda(2) &= 3.\end{aligned}$$

La matrice di transizione della catena a tempo discreto, ovvero la catena “embedded”, associata a tale processo, è:

$$R = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 - e^{-3} & 0 & e^{-3} \\ 1 & 0 & 0 \end{bmatrix}.$$

Da essa è possibile ricavare la seguente matrice dei tassi di transizione $q(i, j) (= \lambda(i) r(i, j), \forall i, j, i \neq j)$:

$$Q = \begin{bmatrix} -2 & 2 & 0 \\ \frac{3-3e^{-3}}{4} & -\frac{3}{4} & \frac{3+3e^{-3}}{4} \\ 3 & 0 & -3 \end{bmatrix}.$$

- (b) La probabilità che, partendo dallo stato 1, dopo 2 ore, ci si ritrovi nello stato 0 è

$$P_2(1, 0),$$

dove P_2 è la matrice della probabilità di transizione al tempo $t = 2$, data da

$$P_2 = e^{Q_2} = \sum_{k=0}^{\infty} 2^k \frac{Q^k}{k!},$$

che è una soluzione particolare delle equazioni di Kolmogorov ($P'(t) = P_t Q$ e $P'(t) = Q P_t$), nel caso $t = 2$.

- (c) La probabilità che i bambini riescano a finire la costruzione del secondo livello, prima che un'onda li costringa a ricominciare ed essendo già alle prese con la costruzione del primo livello, è legata al fatto che la variabile di Poisson relativa al processo di comparsa delle onde arrivi due volte seconda in due gare esponenziali, rispettivamente prima con l'esponenziale di tasso 2 e, poi, con l'esponenziale di tasso all'ora. Allora, si avrà:

$$1^a \text{ gara : } P(\exp(2) \text{ arrivi primo}) = \frac{\lambda(\exp(2))}{\sum_i \lambda_i} = \frac{2}{2 + \frac{1}{3}} = \frac{6}{7};$$

$$2^a \text{ gara : } P(\exp(1) \text{ arrivi primo}) = \frac{\lambda(\exp(1))}{\sum_i \lambda_i} = \frac{1}{1 + \frac{1}{3}} = \frac{3}{4}.$$

Dunque, la probabilità cercata sarà pari a:

$$\frac{6}{7} \cdot \frac{3}{4} = \frac{9}{14} \sim 0.643.$$

Esercizio 3.

Si consideri una CTMC con spazio degli stati $\{0, 1, 2, \dots\}$ e rates di transizione (per $i \neq j$)

$$q(i, j) = \begin{cases} \frac{3+\sin i}{1+i^2}, & \text{se } i^2 < j < 2i^2 + 1 \\ 0, & \text{altrimenti} \end{cases}.$$

- (a) Trovare $P(X_{1.5} = 4 \mid X_0 = 8)$ significa calcolare $P_{1.5}(8, 4)$. Tuttavia, $\forall i, j, i \neq j$, dallo stato i si può arrivare allo stato j solamente se

$$i < j < 2i^2 + 1$$

e ciò non è vero per la coppia $(8, 4)$.

Pertanto, si avrà che

$$P_{1.5}(8, 4) = 0.$$

- (b) Calcolare $P(X_{1.5} \neq 0 \mid X_0 = 0)$ significa calcolare $P_{1.5}(0, x > 0)$, ovvero la probabilità di effettuare un salto da 0 entro un tempo pari a 1.5.

Sia τ_0 l' "holding time" nello stato 0. Sappiamo che

$$\tau_0 \sim \exp(\lambda(0)).$$

Pertanto, si ricava che

$$P_0(\tau_0 < 1.5) = \int_0^{1.5} e^{\lambda(0)x} dx = 1 - e^{-\lambda(0)1.5}$$

dove, sapendo che

$$q(0, 1) = \frac{3 + \sin 0}{1} = 3 = \lambda(0) \cdot r(0, 1)$$

e che $r(0, 1) = 1$ (poiché 1 è l'unico stato raggiungibile da 0), risulta $\lambda(0) = 3$.

In conclusione,

$$P(\tau_0 < 1.5) = 1 - e^{-4.5} \sim 0.99.$$

- (c) Per capire se la catena è esplosiva, possiamo studiare i rates $\lambda(i)$ associati ad ogni stato y_i della catena “embedded”. Risulta:

$$\lambda(0) = 3 + \sin 0,$$

$$\lambda(1) = 3 + \sin 1,$$

...

$$\lambda(n) = 3 + \sin n$$

$$\Rightarrow \sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{\lambda_{y_n}} = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{3 + \sin n} > \sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{4} = +\infty.$$

Allora, la catena non è esplosiva.

Esercizio 4.

Si consideri una CTMC con spazio degli stati $\{0, 1, 2, \dots\}$. Siano $y_i, i \in S$, i relativi stati della catena “embedded”.

(a) Se i tassi di transizione sono

$$q(i, j) = \begin{cases} 2^i & \text{if } j = i + 1 \\ 0 & \text{if } j \neq i \text{ e } j \neq i + 1 \end{cases},$$

allora la catena “embedded” risulta essere una catena di sole “nascite”, dove $r(i, j) = 1, \forall i \neq j$.

Ne consegue che $\lambda(i) = 2^i, \forall i$ e, dunque,

$$\sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{\lambda_{y_n}} = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{2^n} = \sum_{n=0}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n$$

è convergente (essendo una serie geometrica di ragione $\frac{1}{2}$).

Pertanto, la catena è esplosiva.

(b) Se i tassi di transizione sono

$$q(i, j) = \begin{cases} i + 1 & \text{if } i < j \leq i + 5 \\ 0.5 & \text{if } j = i - 1 \text{ e } i \geq 1 \\ 0 & \text{in tutti gli altri casi} \end{cases},$$

risulta che

$$\begin{aligned} \lambda(0) &= 5, \\ \lambda(1) &= \frac{21}{2}, \\ \lambda(2) &= \frac{31}{2}, \\ \lambda(3) &= \frac{31}{2}, \\ &\dots, \end{aligned}$$

da cui si impone lo studio del carattere della serie seguente:

$$\sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{\lambda_{y_n}} = \frac{1}{5} + 2 \sum_{n=2}^{\infty} \frac{1}{10n + 1}.$$

Applicando il “criterio del confronto asintotico” tra

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{10n+1} \text{ e } \sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n},$$

si scopre che

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n}{10n+1} = \frac{1}{10}$$

e, quindi, $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{10n+1}$ diverge, così come $\sum_{n=2}^{\infty} \frac{1}{10n+1}$ (essendo questa nient'altro che la serie confrontata in precedenza con quella armonica, a cui è stato sottratto un termine).

Allora, siccome

$$\frac{1}{5} + 2 \sum_{n=2}^{\infty} \frac{1}{10n+1} > \sum_{n=1}^{\infty} \frac{2}{10n+1} = +\infty,$$

possiamo concludere che la catena non è esplosiva.

(c) Se i tassi di transizione sono

$$q(i, j) = \begin{cases} 2^i & \text{if } j = i + 1 \\ 2^{i+1} & \text{if } j = i - 1 \text{ e } i \geq 2 \\ 0 & \text{in tutti gli altri casi} \end{cases},$$

risulta che

$$\begin{aligned} \lambda(0) &= 1, \\ \lambda(1) &= 1, \\ \lambda(2) &= 3 \cdot 2^2, \\ \lambda(3) &= 3 \cdot 2^3, \\ \lambda(4) &= 3 \cdot 2^4, \\ &\dots, \end{aligned}$$

da cui si impone lo studio del carattere della serie seguente:

$$\sum_{n=0}^{\infty} \frac{1}{\lambda_{y_n}} = 2 + \frac{1}{6} \sum_{n=1}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n.$$

Essendo, tuttavia, verificata la catena di disuguaglianze

$$\frac{1}{6} \sum_{n=1}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n < \sum_{n=1}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n < \sum_{n=0}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n = 2,$$

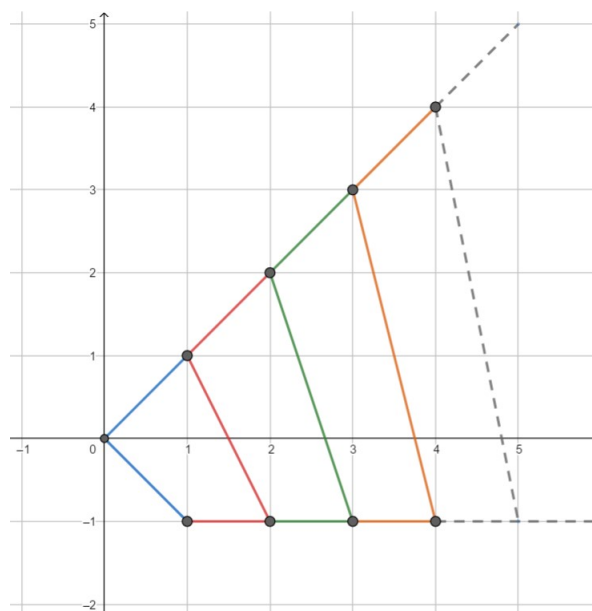
la serie di nostro interesse non può che comportarsi come $\frac{1}{6} \sum_{n=1}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n$
e, dunque, convergere.
Pertanto, la catena risulta esplosiva.

Esercizio 5.

Sia $\Omega = \mathbb{N} \setminus \{0\}$ e $\mathcal{F} = P(\Omega)$.

Si consideri il seguente processo stocastico:

$$\begin{cases} X_0 = 0 \\ X_n = \begin{cases} -1 & \text{se } \omega \leq n \\ n & \text{se } \omega > n \end{cases} \end{cases}.$$



(1) Osserviamo che:

$$\begin{aligned} X_0(\omega) &\in \{0\}, \\ X_1(\omega) &\in \{-1, 1\}, \\ X_2(\omega) &\in \{-1, 2\}, \\ &\dots \text{ e così via.} \end{aligned}$$

Se ne deduce, allora, che, per $n \geq 0$,

$$\mathcal{F}_n = \sigma\{X_0, \dots, X_n\} = \sigma\{\{0\}, \{i, -1\} \mid i : 1, \dots, n\}.$$

(2) Sia

$$\mathbb{P}(A) = \sum_{k \in A} \frac{1}{k(k+1)}.$$

Mostriamo che \mathbb{P} è una probabilità su (Ω, \mathcal{F}) .

- $\mathbb{P}(\emptyset) = 0$, poiché, in tal caso, $\mathbb{P}(\emptyset) = \sum_{k \in \emptyset} \frac{1}{k(k+1)}$ è una sommatoria vuota, dato che non vi sono elementi in \emptyset ;
- $\mathbb{P}(A) \geq 0 \ \forall A \in \mathcal{F}$, poiché $\sum_{k \in A} \frac{1}{k(k+1)} > 0$ sempre, dato che $k \in \mathbb{N} \setminus \{0\}$;
inoltre, se A_1, A_2, \dots è una successione di insiemi mutuamente disgiunti in \mathcal{F} , allora
- $\mathbb{P}\left(\bigcup_{j=1}^{\infty} A_j\right) = \sum_{j=1}^{\infty} \mathbb{P}(A_j)$, poiché, in tal caso, è possibile scrivere

$$\begin{aligned} \mathbb{P}\left(\bigcup_{j=1}^{\infty} A_j\right) &= \sum_{k \in \bigcup_{j=1}^{\infty} A_j} \frac{1}{k(k+1)} = \sum_{k \in A_1} \frac{1}{k(k+1)} + \sum_{k \in A_2} \frac{1}{k(k+1)} + \dots = \\ &\mathbb{P}(A_1) + \mathbb{P}(A_2) + \dots = \sum_{j=1}^{\infty} \mathbb{P}(A_j); \end{aligned}$$

- $\mathbb{P}(\Omega) = 1$, poiché

$$\mathbb{P}(\Omega) = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{k(k+1)} = \sum_{k=1}^{\infty} \left(\frac{1}{k} - \frac{1}{k+1} \right)$$

e, dunque,

$$\begin{aligned} \sum_{n=1}^k \left(\frac{1}{n} - \frac{1}{n+1} \right) &= \left(1 - \frac{1}{2} \right) + \left(\frac{1}{2} - \frac{1}{3} \right) + \dots + \left(\frac{1}{k} - \frac{1}{k+1} \right) = \\ 1 - \frac{1}{k+1} &\longrightarrow 1, \text{ per } k \rightarrow \infty. \end{aligned}$$

Mostriamo che $(X_n)_{n \geq 0}$ è una martingala rispetto a \mathcal{F}_n .

- $(X_n)_{n \geq 0}$ è adattato a \mathcal{F}_n , poiché un processo stocastico è sempre adattato alla filtrazione naturale;
- $X_n \in L^1$, poiché

$$\begin{aligned} \mathbb{E}[|X_n|] &= |-1| \cdot P(\omega_i \leq n) + n \cdot P(\omega_i > n) \leq 1 + n < +\infty \\ \Rightarrow \mathbb{E}[|X_n|] &< +\infty; \end{aligned}$$

- $\mathbb{E}[X_{n+1} | \mathcal{F}_n] = X_n$, poiché

$$\begin{aligned} \mathbb{E}[X_{n+1} - X_n | \mathcal{F}_n] &= P(\omega_i > n+1) + (-1-n) \cdot P(\omega_i = n+1) = \\ &= \sum_{k=n+2}^{\infty} \left(\frac{1}{k(k+1)} \right) + (-1-n) \cdot \frac{1}{(n+1)(n+2)} = \\ &= 1 - \left(1 - \frac{1}{n+2} \right) - \frac{n+1}{(n+1)(n+2)} = \\ &= 1 - \frac{n+1}{n+2} - \frac{1}{n+2} = \\ &= \frac{1}{n+2} - \frac{1}{n+2} = 0. \end{aligned}$$

- (3) La martingala X_n risulta essere limitata in L^1 , poiché, essendo inferiormente limitata da -1 , essa non potrà mai allontanarsi indefinitamente da questo valore. In particolare, risulta:

$$\sup_n \mathbb{E}[|X_n(\omega)|] = \omega - 1.$$

Applicando il “teorema di convergenza” di Doob, allora, si ottiene che

$$X_n \xrightarrow{q.c.} X_\infty \in L^1$$

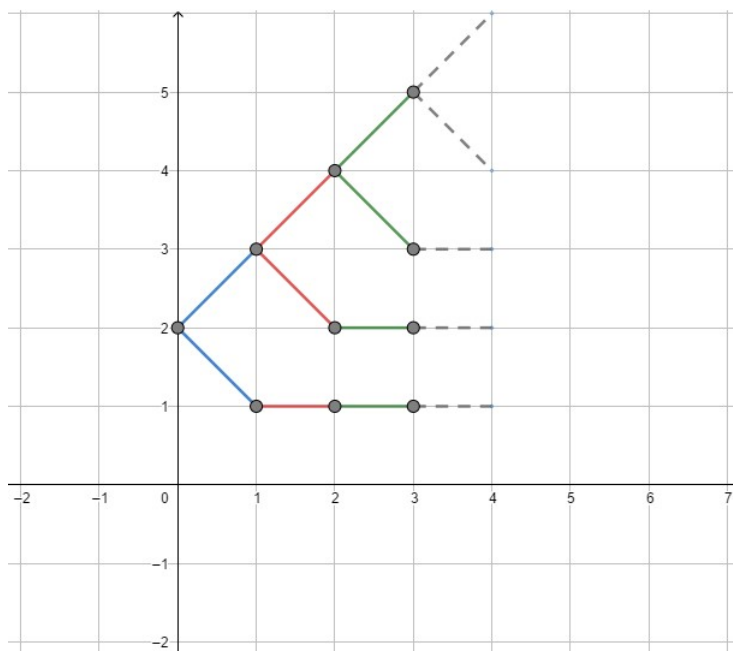
e, quindi, X_∞ deve necessariamente valere -1 .

Esercizio 6.

Sia $\Omega = \mathbb{N} \setminus \{0\}$, $\mathcal{F} = P(\Omega)$ e $\mathbb{P}(A) = \sum_{k \in A} 2^{-k}$.

Si consideri il seguente processo stocastico:

$$\begin{cases} M_n = \omega & \text{se } \omega \leq n \\ M_n = n + 2 & \text{se } \omega > n \end{cases}.$$



(1) Mostriamo che \mathbb{P} è una probabilità su (Ω, \mathcal{F}) .

- $\mathbb{P}(\emptyset) = 0$, poiché, in tal caso, $\mathbb{P}(\emptyset) = \sum_{k \in \emptyset} \frac{1}{2^k}$ è una sommatoria vuota, dato che non vi sono elementi in \emptyset ;
- $\mathbb{P}(A) \geq 0 \ \forall A \in \mathcal{F}$, poiché $\frac{1}{2^k} > 0$ sempre;
inoltre, se A_1, A_2, \dots è una successione di insiemi mutuamente disgiunti in \mathcal{F} , allora
- $\mathbb{P}\left(\bigcup_{j=1}^{\infty} A_j\right) = \sum_{j=1}^{\infty} \mathbb{P}(A_j)$, poiché, in tal caso, è possibile scrivere

$$\begin{aligned} \mathbb{P}\left(\bigcup_{j=1}^{\infty} A_j\right) &= \sum_{k \in \bigcup_{j=1}^{\infty} A_j} \frac{1}{2^k} = \sum_{k \in A_1} \frac{1}{2^k} + \sum_{k \in A_2} \frac{1}{2^k} + \dots = \\ &\mathbb{P}(A_1) + \mathbb{P}(A_2) + \dots = \sum_{j=1}^{\infty} \mathbb{P}(A_j); \end{aligned}$$

- $\mathbb{P}(\Omega) = 1$ poiché, osservando che

$$\sum_{n=1}^{\infty} 2^{-n} = \sum_{n=0}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n - 1$$

e ragionando sulla prima quantità di questa differenza, possiamo scrivere:

$$\begin{aligned} \sum_{n=0}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n &= 1 + \frac{1}{2} + \left(\frac{1}{2}\right)^2 + \dots \\ \Leftrightarrow \left(1 - \frac{1}{2}\right) \sum_{n=0}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n &= \left(1 - \frac{1}{2}\right) \left(1 + \frac{1}{2} + \left(\frac{1}{2}\right)^2 + \dots\right) \\ \Leftrightarrow \left(1 - \frac{1}{2}\right) \sum_{n=0}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n &= \left(1 - \frac{1}{2}\right)^{n+1} \\ \Leftrightarrow \sum_{n=0}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n &= \frac{1 - \left(\frac{1}{2}\right)^{n+1}}{1 - \frac{1}{2}}. \end{aligned}$$

Da ciò segue che

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{n=0}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^n = \frac{1}{\frac{1}{2}} = 2$$

e, pertanto,

$$\sum_{n=1}^{\infty} 2^{-n} = 2 - 1 = 1.$$

Mostriamo che $(M_n)_{n \geq 0}$ è una martingala rispetto alla filtrazione naturale $\mathcal{F}_n = \sigma\{M_0, M_1, \dots, M_n\}$.

- $(M_n)_{n \geq 0}$ è adattato a \mathcal{F}_n , poiché un processo stocastico è sempre adattato alla filtrazione naturale;
- $M_n \in L^1$, poiché

$$\begin{aligned} \mathbb{E}[|M_n|] &= \sum_{i=1}^{\infty} |\omega_i| p_{\omega_i} \mathbb{1}_{\{\omega_i \leq n\}} + |n+2| P(\omega_i > n) \leq \frac{n(n+1)}{2} + n+2 < +\infty \\ \Rightarrow \mathbb{E}[|M_n|] &< +\infty; \end{aligned}$$

- $\mathbb{E}[M_{n+1} | \mathcal{F}_n] = M_n$, poiché

$$\begin{aligned} \mathbb{E}[M_{n+1} - M_n | \mathcal{F}_n] &= 1 \cdot P(\omega_i > n+1) + (-1) \cdot P(\omega_i = n+1) = \\ &= \sum_{k=n+2}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^k - \left(\frac{1}{2}\right)^{n+1} = \\ &= 2 - \frac{2^{n+2} - 1}{2^{n+1}} - \frac{1}{2^{n+1}} = \\ &= \frac{1}{2^{n+1}} - \frac{1}{2^{n+1}} = 0. \end{aligned}$$

(2) M_n è in realtà una martingala ereditaria, poiché

$$M_n = \mathbb{E}[\omega | \mathcal{F}_n],$$

dove ω è una variabile aleatoria $\in L^1$.

Infatti

$$\mathbb{E}[|\omega|] = \sum_{i=1}^{\infty} \omega_i p_{\omega_i} \mathbb{1}_{\{\omega_i \leq n\}} + \sum_{i=1}^{\infty} \omega_i p_{\omega_i} \mathbb{1}_{\{\omega_i > n\}} \leq \frac{n(n+1)}{2} + \sum_{i=1}^{\infty} \frac{n+i}{2^{n+i}} < \infty,$$

poiché $\sum_{i=1}^{\infty} \frac{n+i}{2^{n+i}}$ converge, come mostra l'applicazione del "criterio del rapporto" a tale serie:

$$\lim_{i \rightarrow \infty} \frac{n+i+1}{2^{n+i+1}} \cdot \frac{2^{n+i}}{n+i} = \lim_{i \rightarrow \infty} \frac{n+i+1}{2n+2i} = \frac{1}{2}.$$

Pertanto, essendo M_n una martingala ereditaria, essa converge quasi certamente e in L^1 a M_{∞} , che è anche il limite che la genera, ovvero:

$$M_n \xrightarrow[L^1]{q.c.} M_{\infty} \in L^1,$$

dove

$$M_\infty = \lim_{n \rightarrow \infty} \mathbb{E}[\omega \mid \mathcal{F}_n] = \mathbb{E}[\omega \mid \mathcal{F}_\infty].$$

Inoltre,

$$\mathbb{E}[\omega \mid \mathcal{F}_n] = \mathbb{E}[M_\infty \mid \mathcal{F}_n],$$

dal momento che

$$\mathbb{E}[M_\infty \mid \mathcal{F}_n] = \mathbb{E}[\mathbb{E}[\omega \mid \mathcal{F}_\infty] \mid \mathcal{F}_n] = \mathbb{E}[\omega \mid \mathcal{F}_n].$$

Infine, siccome

$$\mathcal{F}_n = \sigma\{M_0, M_1, \dots, M_n\} = \sigma\{\{2\}, \{1, 3\}, \{1, 2, 4\}, \dots, \{1, 2, 3, 4, \dots, n, n+2\} \mid n \in \mathbb{N}\},$$

$\forall n \geq \omega - 2$, risulta che $\omega \sim \mathcal{F}_n$ e, pertanto, $\omega \sim \mathcal{F}_\infty$; dunque, si avrà:

$$M_\infty = \mathbb{E}[\omega \mid \mathcal{F}_\infty] = \omega.$$

Esercizio 7.

- (1) Sia $M = (M_n)_{n \geq 0}$ una martingala ad incrementi equilimitati (cioè tale che $|M_n - M_{n-1}| \leq K$ con K costante) e sia $M^\tau = (M_n^\tau)_{n \geq 0}$ la corrispondente martingala arrestata al tempo τ , integrabile. Proviamo che M^τ è uniformemente integrabile.

Sia

$$M_n^\tau = M_{\tau \wedge 0} + (M_{\tau \wedge 1} - M_{\tau \wedge 0}) + (M_{\tau \wedge 2} - M_{\tau \wedge 1}) + \dots$$

Sfruttando l' "identità di arresto"

$$M_n^\tau - M_{n-1}^\tau = (M_n - M_{n-1}) \mathbb{1}_{\tau \leq n},$$

otteniamo

$$\begin{aligned} M_n^\tau &= M_0 + (M_1 - M_0) + (M_2 - M_1) + \dots \\ \Leftrightarrow |M_n^\tau| &\leq |M_0| + \sum_{i=1}^n |M_i - M_{i-1}| \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}. \end{aligned}$$

Applicando la maggiorazione

$$|M_n^\tau| \leq |M_0| + \sum_{i=1}^n |M_i - M_{i-1}| \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}} \leq |M_0| + \sum_{i=1}^{\infty} |M_i - M_{i-1}| \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}},$$

ci basterà dimostrare che

$$\mathbb{E}\left[\sum_{i=1}^{\infty} |M_i - M_{i-1}| \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}\right] < +\infty,$$

per poter dire che $|M_n^\tau| \leq Z \in L^1$.

In effetti, ciò è assicurato dal "teorema di convergenza dominata" di Beppo Levi", per il quale risulta che

$$\begin{aligned} \mathbb{E}\left[\sum_{i=1}^{\infty} |M_i - M_{i-1}| \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}\right] &\leq \mathbb{E}\left[\sum_{i=1}^{\infty} K \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}\right] = \\ \mathbb{E}\left[\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^n K \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}\right] &= \lim_{n \rightarrow \infty} \mathbb{E}\left[\sum_{i=1}^n K \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}\right] = \\ \lim_{n \rightarrow \infty} K \sum_{i=1}^n \mathbb{E}[\mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}] &= \lim_{n \rightarrow \infty} K \sum_{i=1}^n P(\tau \geq i) = K \sum_{i=1}^{\infty} P(\tau \geq i) = K \mathbb{E}(\tau) < \infty \end{aligned}$$

(poiché τ è un tempo di arresto integrabile).

Dunque,

$$|M_n^\tau| \leq Z \in L^1 \Rightarrow M_n^\tau \xrightarrow{L^1} M_\tau$$

ed essendo, quindi, M_n^τ limitata in L^1 , per il “teorema di convergenza” di Doob, vale anche

$$M_n^\tau \xrightarrow{q.c.} M_\tau \in L^1.$$

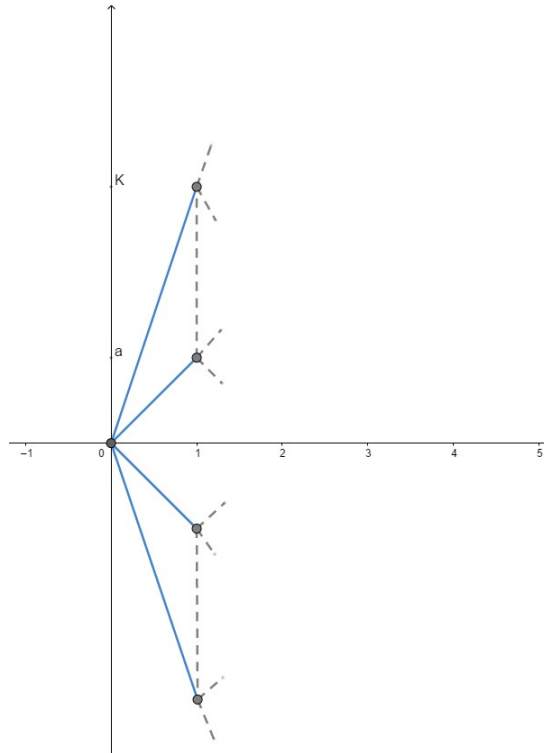
Allora, se

$$M_n^\tau \xrightarrow{L^1} M_\tau \in L^1,$$

per il “teorema di caratterizzazione di martingale in L^1 ”, M^τ è uniformemente integrabile.

(2) Sia $M = (M_n)_{n \geq 0}$ una martingala tale che:

- i) $M_0 = 0$;
- ii) $0 < a \leq |M_n - M_{n-1}| \leq K < +\infty$.



- (a) La martingala in questione non converge q.c. al crescere di n . Questo perché essa, per $n \rightarrow \infty$, può espandersi simmetricamente verso valori infinitamente positivi e negativi. Se, per assurdo, M_n convergesse q.c. a M_∞ , si avrebbe necessariamente che $M_\infty = 0$, da cui

$$\lim_{n \rightarrow \infty} |M_n - M_{n-1}| = 0 \text{ ,}$$

dal momento che $|M_n - M_{n-1}| \geq a > 0, \forall n$.

- (b) Sia $\lambda > 0$ e sia $\tau = \inf n : M_n > \lambda$.

Dal momento che $0 < \lambda < \infty$, possiamo sicuramente affermare che τ è un tempo di arresto finito. Infatti, se la martingala $(M_n)_{n \geq 0}$, per $n \rightarrow +\infty$, si estende indefinitamente a $+\infty$ e $-\infty$, esisterà sicuramente un tempo di ingresso finito τ , in cui essa assumerà il valore finito $\lambda + k$, per un opportuno valore $k \in \mathbb{R}$. Ne consegue che $(M_n^\tau)_{n \geq 0}$ è certamente una martingala.

Proviamo che $\lambda + K - M_n^\tau$ è una martingala.

- $(\lambda + K - M_n^\tau) \sim \mathcal{F}_n$, con \mathcal{F}_n filtrazione naturale del processo $(\lambda + K - M_n^\tau)_{n \geq 0}$;
- $(\lambda + K - M_n^\tau) \in L^1$, poiché $(\lambda + K) \in L^1$ e $M_n^\tau \in L^1$;
- $\mathbb{E}[\lambda + K - M_{n+1}^\tau | \mathcal{F}_n] = \lambda + K - M_n^\tau$, poiché

$$\mathbb{E}[\lambda + K - M_{n+1}^\tau | \mathcal{F}_n] = \mathbb{E}[\lambda + K | \mathcal{F}_n] - \mathbb{E}[M_{n+1}^\tau | \mathcal{F}_n] = \lambda + K - M_n^\tau.$$

Adesso, per provare che $\lambda + K - M_n^\tau$ è una martingala convergente, basta provare che M_n^τ è convergente.

Usando l' "identità di arresto" e le proprietà del valore assoluto, si ottiene

$$|M_n^\tau| \leq \sum_{i=1}^n |M_i - M_{i-1}| \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}},$$

da cui:

$$\begin{aligned} \mathbb{E}[|\sum_{i=1}^n |M_i - M_{i-1}| \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}|] &\leq \mathbb{E}[\sum_{i=1}^n K \mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}] = \\ K \sum_{i=1}^n \mathbb{E}[\mathbb{1}_{\{\tau \geq i\}}] &= K \sum_{i=1}^n P(\tau \geq i) < +\infty \\ \Rightarrow \sup_n \mathbb{E}[|M_n^\tau|] &\leq +\infty. \end{aligned}$$

Pertanto, per il “teorema di convergenza” di Doob,

$$M_n^\tau \xrightarrow{q.c.} M_\tau \in L^1$$

e, dunque, anche $\lambda + K - M_n^\tau$ converge q.c. a $(\lambda + K - M_\tau) \in L^1$.

(c) Il “teorema di arresto opzionale” di Doob afferma che se $M = (M_n)_{n \geq 0}$ è una martingala su Ω e τ è un tempo di arresto per M , supponendo che valga una delle seguenti condizioni:

- i) τ è limitato, ovvero $\exists c$ costante tale che $\tau < c$ q.c.;
- ii) $\mathbb{E}[\tau] < \infty$ ed esiste una costante $K \in \mathbb{R}$ tale che

$$|M_n(\omega) - M_{n-1}(\omega)| \leq K \quad \forall (n, \omega);$$

iii) M è limitata, ovvero $\exists K \in \mathbb{R}$ tale che

$$|M_n(\omega)| \leq K \quad \forall (n, \omega)$$

e τ è finito q.c.;

allora $\mathbb{E}[M_\tau] = \mathbb{E}[M_0]$.

Nel caso della martingala $M = (M_n)_{n \geq 0}$, definita al punto (b), però, risulta che $\mathbb{E}[M_0] = 0$, mentre $\lambda < \mathbb{E}[M_\tau] \leq \lambda + K$.

Di conseguenza, $\mathbb{E}[M_\tau] \neq \mathbb{E}[M_0]$ e quindi, in particolare, τ non è integrabile.