

SVEUČILIŠTE U ZAGREBU
PRIRODOSLOVNO–MATEMATIČKI FAKULTET
MATEMATIČKI ODSJEK

Luka Šimek

HARMONIJSKA ANALIZA I
SLUČAJNI PROCESI

Diplomski rad

Voditelj rada:
prof. dr. sc. Nikola Sandrić

Zagreb, 10. rujna 2025.

Ovaj diplomski rad obranjen je dana _____ pred ispitnim povjerenstvom u sastavu:

1. _____, predsjednik
2. _____, član
3. _____, član

Povjerenstvo je rad ocijenilo ocjenom _____.

Potpisi članova povjerenstva:

1. _____
2. _____
3. _____

Sadržaj

Sadržaj	iii
Uvod	2
1 Valići	3
2 Slučajni procesi u neprekidnom vremenu	5
2.1 Osnovni pojmovi	5
2.2 Poissonov proces	6
2.3 Brownovo gibanje	8
2.4 Beskonačno djeljive distribucije	11
2.5 Markovljevi procesi i modifikacije	15
2.6 Samosličnost	23
3 Hölder-regularnost trajektorija FBM	29
3.1 Reprezentacija Brownovog gibanja slučajnim redom	29
3.2 FBM i integralne reprezentacije	31
Bibliografija	35

Uvod

Slučajni procesi su višestruko zanimljivi — iz perspektive drugih znanosti jer se njima modeliraju razne veličine koje se mijenjaju kroz vrijeme, i u teoriji vjerojatnosti jer podrazumijevaju kompliciraniju i bogatiju strukturu nego familije nezavisnih slučajnih varijabli. Zbog njihove velike važnosti, razumno se pitati koji nam sve alati mogu pomoći da ih bolje razumijemo. Harmonijska analiza nameće se kao mogući odgovor. Kao i većina matematičkih disciplina, harmonijska analiza nema strogu definiciju, ali možemo reći da se bavi reprezentacijom funkcija u *frekvencijskoj* domeni, za razliku od uobičajene vremenske. Pogled na taj alternativni prikaz funkcije često može teške probleme u vremenskoj domeni znatno olakšati u frekvencijskoj. Primjer nam je poznat i u teoriji vjerojatnosti — upravo su karakteristične funkcije Fourierove transformacije vjerojatnosnih mjera, a znamo da su u teoriji vjerojatnosti jedan od najvažnijih analitičkih alata.

Uža tema ovog rada je Hölder-regularnost trajektorija frakcionalnog Brownovog gibanja (poglavlje 3). Frakcionalno Brownovo gibanje primjer je *samosličnog* slučajnog procesa, a i generalizacija poznatijeg Brownovog gibanja (koje je također samoslično). Samosličnost kod slučajnih procesa podrazumijeva da se distribucija procesa ne mijenja skaliranjem u vremenu i odgovarajućim skaliranjem po amplitudi. Drugim riječima, slična statistička svojstva vrijede i u malim i u velikim rezolucijama. Samoslični slučajni procesi ponekad se nazivaju i *statistički fraktali*, iako se frakcionalno Brownovo gibanje pojavljuje u radovima Kolmogorova više od dvadeset godina prije no što Mandelbrot uvodi izraz *fraktal* (citirati). Za analizu takvih procesa prirodno pogoduju valići koje detaljno uvodimo u poglavlju 1, o čemu najbolje govori ovaj citat iz [AFT00, str. 22.]:

Štoviše, čim su se pojavile sredinom osamdesetih, gotovo se odmah prepoznalo da su valićne transformacije, zahvaljujući svojoj ugrađenoj multirezolucijskoj strukturi, prirodni alati za otkrivanje samosličnih pojava u signalima, slikama i procesima.

Osim posljednjeg trećeg poglavlja, ovaj rad se sastoji od dva pripremna poglavlja

kojima je cilj predstaviti osnovne pojmove, rezultate i tehnike u svojim područjima — redom teoriji valića i teoriji slučajnih procesa u neprekidnom vremenu.

- U prvom poglavlju...
- U drugom poglavlju...
- U trećem poglavlju...

Glavnu literaturu čine [Dau92] za prvo poglavlje, [Sat99; EM02; Sar80] za drugo poglavlje i [Aya10] za treće poglavlje.

Poglavlje 1

Valići

Poglavlje 2

Slučajni procesi u neprekidnom vremenu

2.1 Osnovni pojmovi

Slučajni proces je indeksirana familija slučajnih veličina $\{X_t : t \in T\}$ na istom vjerojatnosnom prostoru gdje je T neki indeksni skup. On može biti diskretan (npr. $T = \mathbb{N}$ ili $T = \mathbb{Z}$) ili neprekidan (npr. $T = \mathbb{R}$ ili $T = [0, \infty)$). Budući da o elementima T često razmišljamo kao o vremenskim trenucima, govorimo o procesu u diskretnom ili u neprekidnom vremenu. U kontekstu ovog rada podrazumijevamo $T = [0, \infty)$ i koristimo skraćenu notaciju $\{X_t\}$.

Razlikujemo proces od realizacije $t \mapsto X_t(\omega)$ za fiksni $\omega \in \Omega$ koju još zovemo *trajektorijom*. Nadalje, kažemo da je slučajni proces $\{X_t\}$ *modifikacija* procesa $\{Y_t\}$ ako je $\mathbb{P}(X_t = Y_t) = 1$ za sve $t \in [0, \infty)$. Primijetimo razliku u odnosu na jači uvjet $\mathbb{P}(X_t = Y_t, \forall t \in [0, \infty)) = 1$ kada procese više načelno ne razlikujemo. Jednakost dvaju procesa po distribuciji znači jednakost svih konačnodimenzijskih distribucija.

Slučajne procese obično promatramo preko konačnodimenzijskih funkcija distribucije F_{t_1, \dots, t_n} , $t_j \in T$, koje zadovoljavaju tzv. uvjete suglasnosti Kolmogorova. Dva su važna rezultata koja to opravdaju — teorem Kolmogorova (v. [Sar80, tm. 9.6], alternativa sa suglasnim mjerama [Sat99, tm. 1.8]) koji tvrdi da suglasna familija konačnodimenzijskih distribucija inducira jedinstvenu vjerojatnosnu mjeru na σ -algebri cilindara i drugi teorem (v. [Sar80, tm. 9.7]) koji tvrdi da se za takvu familiju uvijek može konstruirati slučajni proces (odn. vjerojatnosni prostor) s upravo tim konačnodimenzijskim distribucijama. Stoga nam, kao i obično, nije bitan vjerojatnosni prostor u kojem se nalazimo.

Sada ćemo definirati Lévyjeve procese, jednu od najznamenitijih klasa slučajnih procesa. Uvest ćemo Poissonov proces i Brownovo gibanje kao poznate primjere. Pokazat ćemo i vrlo blisku vezu Lévyjevih procesa i beskonačno djeljivih distribucija (definiranih u odjeljku 2.4), koja je potrebna za naš dokaz da Brownovo gibanje postoji. Nakon toga ćemo skrenuti pažnju na teoriju samosličnih procesa i uvesti frakcionalno Brownovo gibanje kao generalizaciju u poglavlju 3. Prije te definicije, uvedimo još jedan osnovni pojam.

Definicija 2.1.1. Slučajni proces $\{X_t\}$ je *stohastički neprekidan* ili *neprekidan po vjerojatnosti* ako vrijedi

$$\lim_{s \rightarrow t} \mathbb{P}(|X_s - X_t| > \varepsilon) = 0,$$

za svaki $t \geq 0$ i $\varepsilon > 0$.

Definicija 2.1.2. Slučajni proces $\{X_t\}$ u \mathbb{R}^d je *Lévyjev* ako vrijede uvjeti:

- (i) $X_0 = 0$ g.s.,
- (ii) $\{X_t\}$ je stohastički neprekidan,
- (iii) varijable $X_{t_0}, X_{t_1} - X_{t_0}, \dots, X_{t_n} - X_{t_{n-1}}$ su nezavisne za sve $n \geq 1$ i $0 \leq t_1 < t_2 < \dots < t_n$ (nezavisnost prirasta),
- (iv) distribucija varijable $X_{s+t} - X_s$ ne ovisi o s (stacionarnost prirasta),
- (v) Postoji $\Omega_0 \in \mathcal{F}$ takav da je $\mathbb{P}(\Omega_0) = 1$ te za svaki $\omega \in \Omega_0$ vrijedi da je trajektorija $t \mapsto X_t(\omega)$ càdlàg¹.

Nadalje, ako ne vrijedi (iv) kažemo da je proces *aditivan*. Ako ne vrijedi (v) tada kažemo da je proces *Lévyjev po distribuciji* odn. *aditivan po distribuciji*.

2.2 Poissonov proces

U ovom odjeljku uvodimo Poissonov proces kao primjer Lévyjevog procesa. Intuitivno, taj proces mjeri broj događaja koji su se dogodili do trenutka t , pri čemu su duljine intervala između uzastopnih događaja distribuirane eksponencijalno. Pritom, eksponencijalnu distribuciju karakterizira tzv. gubitak pamćenja. Poissonov proces uvest ćemo kao Lévyjev proces s dodatnim svojstvom da je $X_t \sim P(\lambda t)$, a onda konstrukcijom dokazati da takav proces zaista postoji. Kasnije ćemo pokazati da je moguće na taj način odrediti Lévyjev proces i kad se Poissonova distribucija zamijeni bilo kojom beskonačno djeljivom distribucijom.

Definicija 2.2.1. Slučajni proces $\{X_t\}$ na \mathbb{R} je *Poissonov proces s parametrom $\lambda > 0$* ako je Lévyjev i ako

$$X_t \sim P(\lambda t), \quad t > 0. \quad (2.1)$$

Teorem 2.2.2. Neka je $(W_n)_{n \geq 0}$ slučajna šetnja na \mathbb{R} definirana na vjerojatnosnom prostoru $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$, takva da $T_n = W_n - W_{n-1}$ ima eksponencijalnu distribuciju s parametrom $\lambda > 0$. Definiramo

$$X_t(\omega) = n \iff W_n(\omega) \leq t < W_{n+1}(\omega), \quad \omega \in \Omega. \quad (2.2)$$

Tada je $\{X_t\}$ Poissonov proces s parametrom λ .

¹càdlàg, od fr. *continue à droite, limite à gauche*, označava funkciju koja je na cijeloj domeni neprekidna zdesna s limesima slijeva

Dokaz. Ustanovimo prvo da $W_n \sim \Gamma(n, \lambda)$. Naime, $T_n \sim \text{Exp}(\lambda) \equiv \Gamma(1, \lambda)$ i $W_n = \sum_{j=1}^n T_j$ pa tvrdnja slijedi po poznatoj lemi o zbroju nezavisnih Γ -distribuiranih varijabli². Sada slijedi $\mathbb{P}(W_n \leq t) \rightarrow 0, n \rightarrow \infty$, što se može dobiti i iz

$$\mathbb{P}(W_n \leq t) \leq \mathbb{P}(T_1 \leq t, T_2 \leq t, \dots, T_n \leq t) = [\mathbb{P}(T_1 \leq t)]^n \rightarrow 0, n \rightarrow \infty.$$

Slijedi da je svaka X_t g.s. dobro definirana preko (2.2). Da je $\{X_t\}$ stohastički neprekidan s càdlàg trajektorijama i $X_0 = 0$ g.s. je trivijalno. Preostaje dokazati (2.1) i da su prirasti stacionarni i nezavisni.

Prvo se dobije iz

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(X_t = n) &= \mathbb{P}(W_n \leq t < W_n + T_{n+1}) = \int_{\mathbb{R}^2} 1_{\{(u,v) \in \mathbb{R}^2 : 0 \leq u \leq t < u+v\}}(x, y) d\mathbb{P}_{(W_n, T_{n+1})} \\ &= \frac{\lambda^{n+1}}{(n-1)!} \int_0^t x^{n-1} e^{-\lambda x} \int_{t-x}^\infty e^{-\lambda y} dy dx = \frac{(\lambda t)^n}{n!} e^{-\lambda t}, \end{aligned}$$

pri čemu koristimo nezavisnost varijabli W_n i T_{n+1} za prelazak na njihove gustoće.

Sličnim izravnim računom možemo dobiti i

$$\mathbb{P}(W_{n+1} > t + s \mid X_t = n) = e^{-cs} = \mathbb{P}(T_1 > s), \quad t > 0, s \geq 0, n \geq 0.$$

Pomoću toga možemo dobiti da $(W_{n+1} - t, T_{n+2}, \dots, T_{n+m})$ uz dano $X_t = n$ ima jednaku distribuciju kao i (T_1, T_2, \dots, T_m) . Vrijedi:

$$\begin{aligned} &\mathbb{P}(W_{n+1} - t > s_1, T_{n+2} > s_2, \dots, T_{n+m} > s_m \mid X_t = n) \\ &= \mathbb{P}(W_n \leq t, W_{n+1} - t > s_1, T_{n+2} > s_2, \dots, T_{n+m} > s_m) / \mathbb{P}(X_t = n) \\ &= \mathbb{P}(W_n \leq t, W_{n+1} - t > s_1) \mathbb{P}(T_{n+2} > s_2, \dots, T_{n+m} > s_m) / \mathbb{P}(X_t = n) \\ &= \mathbb{P}(W_{n+1} - t > s_1 \mid X_t = n) \mathbb{P}(T_{n+2} > s_2, \dots, T_{n+m} > s_m) \\ &= \mathbb{P}(T_1 > s_1) \mathbb{P}(T_2 > s_2, \dots, T_m > s_m) \\ &= \mathbb{P}(T_1 > s_1, T_2 > s_2, \dots, T_m > s_m). \end{aligned} \tag{2.3}$$

To nam zatim daje

$$\begin{aligned} &\mathbb{P}(W_{n+m} \leq t + s < W_{n+m+1} \mid X_t = n) \\ &= \mathbb{P}((W_{n+1} - t) + T_{n+2} + \dots + T_{n+m} \leq s < (W_{n+1} - t) + T_{n+2} + \dots + T_{n+m+1}) \\ &\stackrel{(2.3)}{=} \mathbb{P}(T_1 + \dots + T_m \leq s < T_1 + \dots + T_m + T_{m+1}) = \mathbb{P}(W_m \leq s < W_{m+1}) = \mathbb{P}(X_s = m). \end{aligned}$$

Sada stacionarnost prirasta slijedi sumiranjem po $n \geq 0$ jednakosti:

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(X_{t+s} - X_t = m, X_t = n) &= \mathbb{P}(X_{t+s} = n + m, X_t = n) \\ &= \mathbb{P}(X_t = n) \mathbb{P}(W_{n+m} \leq t + s < W_{n+m+1} \mid X_t = n) = \mathbb{P}(X_t = n) \mathbb{P}(X_s = m). \end{aligned}$$

²zbroj je Γ -distribuiran, a prvi parametar (parametar oblika) je zbroj prvih parametara sumanada

Nezavisnost prirasta slijedi iz

$$\begin{aligned} & \mathbb{P}(X_{t_0} = n_0, X_{t_1} - X_{t_0} = n_1, \dots, X_{t_k} - X_{t_{k-1}} = n_k) \\ &= \mathbb{P}(X_{t_0} = n_0, X_{t_1} = n_0 + n_1, \dots, X_{t_k} = n_0 + \dots + n_k \mid X_{t_0} = n_0) \mathbb{P}(X_{t_0} = n_0) \\ &= \mathbb{P}(X_{t_1-t_0} = n_1, \dots, X_{t_k-t_0} = n_1 + \dots + n_k) \mathbb{P}(X_{t_0} = n_0) \end{aligned}$$

gdje druga jednakost slijedi primjenom iste ideje kao u dokazu stacionarnosti. Dokaz se završi indukcijom. \square

2.3 Brownovo gibanje

Sada na slični način uvodimo Brownovo gibanje.

Definicija 2.3.1. Slučajni proces $\{X_t\}$ u \mathbb{R}^d je *Brownovo gibanje* (ili *Wienerov proces*) ako je Lévyjev i ako

- (i) $X_t \sim N(0, tI)$ i
- (ii) postoji $\Omega_0 \in \mathcal{F}$ takav da je $\mathbb{P}(\Omega_0) = 1$ i $\omega \in \Omega_0$ povlači da je trajektorija $t \mapsto X_t(\omega)$ neprekidna.

Ovime nismo dokazali da takav proces postoji, što ćemo ostaviti za kasnije. Dana svojstva su nam dovoljna da dokažemo nekoliko osnovnih rezultata o Brownovom gibanju. Dokažat ćemo par nama najznačajnijih rezultata, a drugi se mogu naći u [Sat99, §5]. Spomenimo još kako je svojstvo (i) skupa s Lévyjevosti dovoljno za (ii) po teoremu 2.5.11.

Prvo ćemo dokazati da Brownovo gibanje zadržava istu distribuciju pri širenju u vremenu i odgovarajućem širenju u prostoru. To svojstvo ćemo kasnije zvati *samosličnost*.

Teorem 2.3.2. Neka je $\{X_t\}$ Brownovo gibanje u \mathbb{R}^d . Tada je $\{c^{-1/2}X_{ct}\}$ također Brownovo gibanje u \mathbb{R}^d za svaki $c > 0$.

Dokaz. Neka je $Y_t = c^{-1/2}X_{ct}$. Odmah slijedi $Y \sim N(0, tI)$. Stohastička neprekidnost, g.s. neprekidnost trajektorija i nezavisnost prirasta lako se svedu na isto za $\{X_t\}$.

Stacionarnost prirasta također — neka $0 \leq s < t$ pa

$$Y_t - Y_s = c^{-1/2}(X_{ct} - X_{cs}) \stackrel{d}{=} c^{-1/2}X_{ct-cs} \stackrel{d}{=} Y_{t-s}.$$

\square

Sada ćemo dokazati da u jednoj dimenziji g.s. vrijede dva inače neuobičajena svojstva — nigdje-monotonost i nigdje-diferencijabilnost.³

³ustvari je dovoljno dokazati nigdje-diferencijabilnost; Lebesgueov teorem o diferencijabilnosti monotonih funkcija govori da je svaka neprekidna monotona funkcija diferencijabilna g.s., v. [Sat99, remark 5.10] za još dovoljnih uvjeta

Teorem 2.3.3. *Neka je $\{X_t\}$ Brownovo gibanje u \mathbb{R} . Gotovo sigurno je $t \mapsto X_t(\omega)$ nigdje-monotona, tj. postoji $\Omega_1 \in \mathcal{F}$ takav da $\mathbb{P}(\Omega_1) = 1$ i $\omega \in \Omega_1$ povlači da $t \mapsto X_t(\omega)$ nije monotona niti na jednom segmentu.*

Dokaz. Bez smanjenja općenitosti dokazujemo samo nigdje-rastućost na segmentu⁴ $[a, b] \subset [0, \infty)$. Neka je još $n \geq 2$ proizvoljan i Ω_0 iz definicije 2.3.1. Definiramo

$$A = \{\omega \in \Omega_0 : t \mapsto X_t(\omega) \text{ ne opada na } [a, b]\}$$

i zatim ekvidistantnu particiju segmenta $[a, b]$ s $t_k = a + \frac{b-a}{n} \cdot k$, $0 \leq k \leq n$ te

$$A_n = \{\omega \in \Omega_0 : X_{t_0}(\omega) \leq X_{t_1}(\omega) \leq \dots \leq X_{t_n}(\omega)\} \in \mathcal{F}.$$

Očito $A \subset A_n$ i

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(A_n) &\leq \mathbb{P}\left(\bigcap_{k=1}^n \{X_{t_k} - X_{t_{k-1}} \geq 0\}\right) \\ &= \prod_{k=1}^n P(X_{t_k} - X_{t_{k-1}} \geq 0) = 2^{-n} \rightarrow 0, \quad n \rightarrow \infty \end{aligned}$$

pa možemo odabrati

$$\Omega_1 = \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n^c \in \mathcal{F}.$$

□

Komentar 2.3.4. Štoviše, vrijedi

$$A = \bigcap_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathcal{F}.$$

Inkluzija \subseteq je očita. Za \supseteq pretpostavimo $\omega \in \bigcap_n A_n \setminus A$. Tada postoje $a \leq s < t \leq b$ takvi da $X_s(\omega) - X_t(\omega) > \varepsilon$ za neki $\varepsilon > 0$. Jer je skup

$$\Delta = \bigcup_{n=1}^{\infty} \Delta_n, \quad \Delta_n = \left\{ a + \frac{b-a}{n} \cdot k : 0 \leq k \leq n \right\}$$

gust u $[a, b]$ i zbog neprekidnosti trajektorije postoje n i $s', t' \in \Delta_n$ takvi da $X_{s'}(\omega) - X_{t'}(\omega) > \varepsilon/2$. Time smo došli do kontradikcije jer $\omega \notin A_n$.

Teorem 2.3.5. *Neka je $\{X_t\}$ Brownovo gibanje u \mathbb{R} . Gotovo sigurno je $t \mapsto X_t(\omega)$ nigdje-diferencijabilna, tj. postoji $\Omega_1 \in \mathcal{F}$ takav da $\mathbb{P}(\Omega_1) = 1$ i $\omega \in \Omega_1$ povlači da $t \mapsto X_t(\omega)$ nije diferencijabilna niti u jednoj točki $t \in [0, \infty)$.*

⁴to možemo jer svaki segment $[a, b]$ možemo smanjiti na $[a', b']$ gdje $a', b' \in \mathbb{Q}$ i onda „ukupni” Ω_1 dobiti kao prebrojivi presjek „lokalnih”

Dokaz. Slično kao u prošlom dokazu, ograničimo se na pitanje diferencijabilnosti u nekom $t \in [0, N]$ gdje $N \in \mathbb{N}$. Stavimo

$$A = \{\omega \in \Omega : t \mapsto X_t(\omega) \text{ je diferencijabilna u nekom } s \in [0, N]\}$$

i za $M, n \in \mathbb{N}$

$$A_{n,M} = \{\omega \in \Omega : (\exists s \in [0, N(1 - 1/n)])(|t - s| \leq 2N/n \implies |X_t(\omega) - X_s(\omega)| \leq M|t - s|)\}. \quad (2.4)$$

Lako se pokaže

$$A \subseteq \bigcup_{M=1}^{\infty} \bigcup_{n=1}^{\infty} A_{n,M}.$$

Fiksiramo $M \in \mathbb{N}$ i stavimo $A_n = A_{n,M}$. Nadalje uvedimo mrežu $t_k = \frac{Nk}{n}$, $0 \leq k \leq n$ i definiramo slučajne varijable⁵

$$Y_{n,k} = \max\{|X_{t_k} - X_{t_{k-1}}|, |X_{t_{k+1}} - X_{t_k}|, |X_{t_{k+2}} - X_{t_{k+1}}|\}, \quad 0 \leq k \leq n-2.$$

Definiramo još događaje

$$B_n = \bigcup_{k=0}^{n-2} \{Y_{n,k} \leq 4MN/n\}.$$

Neka je $\omega \in A_n$ i s iz (2.4). Lako se pokaže da je $\omega \in \{Y_{n,k} \leq 4MN/n\}$ gdje je k takav da s nije udaljen ni od kojeg ruba segmenta $[t_{k-1}, t_{k+2}]$ za više od $2N/n$. Dakle, $A_n \subseteq B_n$.

Uvedimo oznaku $a_n = \mathbb{P}(|X_{N/n}| \leq 4MN/n)$. Pomoću stacionarnosti i nezavisnosti prirasta dobivamo

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(B_n) &\leq \sum_{k=0}^{n-2} \mathbb{P}(Y_{n,k} \leq 4MN/n) = \mathbb{P}(Y_{n,0}) + \sum_{k=1}^{n-2} \mathbb{P}(Y_{n,k}) \\ &= \mathbb{P}(|X_{t_1} - X_{t_0}| \leq 4MN/n, |X_{t_2} - X_{t_1}| \leq 4MN/n) + \\ &\quad + \sum_{k=1}^{n-2} \mathbb{P}\left(\bigcap_{\ell=0}^3 \{|X_{t_{k+\ell}} - X_{t_{k+\ell-1}}| \leq 4MN/n\}\right) \\ &= a_n^2 + (n-2)a_n^3. \end{aligned}$$

Želimo odozgo ocijeniti a_n . Prvo iz teorema 2.3.2 imamo $X_{N/n} \stackrel{d}{=} (N/n)^{1/2} X_1$. Ako gustoću jedinične normalne distribucija ocijenimo odozgo konstantom, imamo

$$a_n = \mathbb{P}\left(|X_1| \leq 4M(N/n)^{1/2}\right) \lesssim \left(\frac{N}{n}\right)^{1/2}.$$

⁵za $k = 0$ maknemo prvi element skupa

Iz toga slijedi $\mathbb{P}(B_n) \rightarrow 0$, $n \rightarrow \infty$ pa i $\mathbb{P}(\liminf_n B_n) = 0$. Tvrdnja teorema slijedi jer

$$\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n = \liminf_{n \rightarrow \infty} A_n \subseteq \liminf_{n \rightarrow \infty} B_n.$$

□

2.4 Beskonačno djeljive distribucije

U ovom odjeljku uvodimo pojam beskonačno djeljive distribucije odn. mjere.⁶ Beskonačno djeljive distribucije su u vrlo bliskoj vezi s Lévyjevim procesima. Naime, dokazat ćemo da

- za svaku beskonačno djeljivu distribuciju μ postoji Lévyjev po distribuciji proces $\{X_t\}$ jedinstven po distribuciji takav da $\mathbb{P}_{X_1} = \mu$ i
- svaki proces Lévyjev po distribuciji ima modifikaciju koja je Lévyjev proces (u sljedećem odjeljku 2.5).

Posljedica je da svakom beskonačno djeljivom distribucijom (među kojima su i Poissonova i normalna, v. komentar 2.4.3) možemo odrediti Lévyjev proces kako smo to napravili u definicijama 2.2.1 i 2.3.1. Da dokažemo da Brownovo gibanje postoji još je potrebna i neprekidnost trajektorija, a nju ćemo dokazati u teoremu 2.5.11.

Sada definiramo beskonačno djeljivu distribuciju preko tri ekvivalentne tvrdnje. Da su ekvivalentne lako se vidi jer konvolucija mjere i zbrajanje nezavisnih slučajnih varijabli odgovaraju množenju odgovarajućih karakterističnih funkcija. Ako je μ konačna mjera, s μ^n označavamo n -kratnu konvoluciju μ same sa sobom.

Definicija 2.4.1. Neka je X slučajna varijabla na \mathbb{R}^d i μ odgovarajuća vjerojatnosna mjera. Tada:

- kažemo da je μ *beskonačno djeljiva* ako za svaki $n \in \mathbb{N}$ postoji vjerojatnosna mjera μ_n takva da $\mu = \mu_n^n$,
- kažemo da X ima beskonačno djeljivu distribuciju ako za svaki $n \in \mathbb{N}$ postoje n.j.d. varijable X_1, \dots, X_n takve da

$$X \stackrel{d}{=} X_1 + X_2 + \dots + X_n,$$

- μ je beskonačno djeljiva ako za svaki $n \in \mathbb{N}$ postoji $\hat{\mu}_n: \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{C}$ takva da je karakteristična funkcija neke vjerojatnosne distribucije i $\hat{\mu}(z) = \hat{\mu}_n(z)^n$ za svaki $z \in \mathbb{R}^d$.

⁶često poistovjećujemo vjerojatnosnu mjeru i odgovarajuću vjerojatnosnu funkciju distribucije (v. [Sar80, str. 257])

U sljedećoj propoziciji bez dokaza navodimo osnovna svojstva beskonačno djeljivih distribucija (v. [Sat99, §7] i [Sar80, §13, 14]). Najvažnije nam je vidjeti da logaritmiražne i potenciranje beskonačno djeljivih mjera ima neka očekivana lijepa svojstva — jedinstvenost, neprekidnost i dobro granično ponašanje.

Propozicija 2.4.2. (i) Ako su μ_1 i μ_2 beskonačno djeljive, tada je to i $\mu_1 * \mu_2$.

(ii) Ako je μ beskonačno djeljiva tada $\hat{\mu}(z) \neq 0$ za svaki $z \in \mathbb{R}^d$.

(iii) Neka je $\varphi: \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{C}$ takva da $\varphi(0) = 1$ i $\varphi(z) \neq 0$ za sve $z \in \mathbb{R}^d$. Tada postoji jedinstvena neprekidna funkcija $f: \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{C}$ takva da $f(0) = 0$ i $e^{f(z)} = \varphi(z)$. Za svaki $n \in \mathbb{N}$ postoji jedinstvena neprekidna funkcija $g_n: \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{C}$ takva da $g_n(0) = 1$ i $g_n(z)^n = \varphi(z)$. Vrijedi $g_n(z) = e^{f(z)/n}$. Pišemo $f = \log \varphi$ i $g_n = \varphi^{1/n}$.

(iv) Neka su φ i $(\varphi_n)_n$ kao u uvjetima t. (iii). Ako $\varphi_n \rightarrow \varphi$ uniformno na svakom kompaktnom skupu, tada $\log \varphi_n \rightarrow \log \varphi$ uniformno na svakom kompaktnom skupu.

(v) Ako je $(\mu_n)_n$ niz beskonačno djeljivih vjerojatnosnih mjera i $\mu_n \xrightarrow{w} \mu$, tada je i μ beskonačno djeljiva.

(vi) Ako je μ beskonačno djeljiva, tada je μ^t dobro definirana i beskonačno djeljiva za svaki $t \in [0, \infty)$.

Komentar 2.4.3. Razmotrimo primjere beskonačno djeljivih distribucija.

- Neka je $X \sim N(\mu, \sigma^2)$. Za $n \in \mathbb{N}$ definiramo $X_k \sim N(\mu/n, \sigma^2/n)$ n.j.d. pa je

$$X_n \stackrel{d}{=} X_1 + \cdots + X_n.$$

Po definiciji slijedi da je normalna distribucija beskonačno djeljiva. Istu ideju možemo primijeniti da dokažemo da su beskonačno djeljive Poissonova, Γ i δ -distribucije. Ekvivalentno je gledati korijene karakterističnih funkcija i vidjeti da odgovaraju istom tipu distribucije s različitim parametrima. Tako su još beskonačno djeljive Cauchyjeva i negativna binomna distribucija.

- Uniformna i binomna distribucija nisu beskonačno djeljive. Za uniformnu karakteristična funkcija ima nultočke (prop. 2.4.2, t. (ii)). Za binomnu to nije slučaj, ali nije beskonačno djeljiva pa to pokazuje da ne vrijedi obrat. U [Sat99] se u kasnijim poglavljima pokazuje da su δ -distribucije jedine beskonačno djeljive distribucije s kompaktnim nosačem.
- Ako je $\{X_t\}$ Lévyjev je \mathbb{P}_{X_1} beskonačno djeljiva. Za $n \in \mathbb{N}$ definiramo $t_k = k/n$, $0 \leq k \leq n$ pa

$$X_1 = \sum_{k=0}^n (X_{t_k} - X_{t_{k-1}}) \quad \text{g.s.}$$

Tvrđnja slijedi zbog stacionarnosti i nezavisnosti prirasta.

Slijedi glavni rezultat ovog odjeljka koji smo najavili na početku.

Teorem 2.4.4. (i) Ako je X_t Lévyjev po distribuciji, tada je \mathbb{P}_{X_t} beskonačno djeljiva za svaki $t \geq 0$ i $\mathbb{P}_{X_t} = \mathbb{P}_{X_1}^t$.

(ii) Ako je μ beskonačno djeljiva distribucija, tada postoji Lévyjev proces po distribuciji $\{X_t\}$ takav da $\mathbb{P}_{X_1} = \mu$.

(iii) Ako su $\{X_t\}$ i $\{X'_t\}$ Lévyjevi procesi po distribuciji takvi da $\mathbb{P}_{X_1} = \mathbb{P}_{X'_1}$, tada $\{X_t\} \stackrel{d}{=} \{X'_t\}$.

Dokaz. Dokažimo prvo (i). Da je \mathbb{P}_{X_t} beskonačno djeljiva za sve $t \geq 0$ slijedi istom konstrukcijom kao u komentaru 2.4.3. Iz nje štoviše slijedi $\mathbb{P}_{X_{1/n}} = \mathbb{P}_{X_1}^{1/n}$ i zatim po prop. 2.4.2 je $\mathbb{P}_{X_{m/n}} = \mathbb{P}_{X_1}^{m/n}$. Dakle, tvrdnju smo dokazali za sve $t \in \mathbb{Q}_{\geq 0}$. Neka je sada t iracionalan i $t_n \rightarrow t$ gdje $t_n \in \mathbb{Q}$. Stohastičku neprekidnost u t možemo zapisati kao $X_{t_n} \xrightarrow{\mathbb{P}} X_t$ pa konvergencija vrijedi i po distribuciji te povlači konvergenciju mjera $\mathbb{P}_{X_{t_n}}^t = \mathbb{P}_{X_{t_n}} \xrightarrow{w} \mathbb{P}_{X_t}$. Također $\mathbb{P}_{X_1}^t \xrightarrow{w} P_{X_1}^t$ po prop. 2.4.2, t. (iii). Tvrdnja slijedi zbog jedinstvenosti limesa (npr. prop. 13.7 u [Sar80]).

Sada dokažimo (iii). Po (i) slijedi $X_t \stackrel{d}{=} X'_t$ za $t \geq 0$ i po stacionarnosti prirasta $X_{s+t} - X_s \stackrel{d}{=} X'_{s+t} - X'_s$ za $s, t \geq 0$. Zbog nezavisnosti komponenti jednako su distribuirani i vektori⁷

$$(X_{t_0}, X_{t_1} - X_{t_0}, \dots, X_{t_n} - X_{t_{n-1}}) \stackrel{d}{=} (X'_{t_0}, X'_{t_1} - X'_{t_0}, \dots, X'_{t_n} - X'_{t_{n-1}}) \quad (2.5)$$

za sve $n \in \mathbb{N}$ i $0 \leq t_0 < t_1 < \dots < t_n$. Primjenom izmjerivog preslikavanja

$$(x_0, x_1, \dots, x_n) \mapsto (x_0, x_0 + x_1, \dots, x_0 + x_1 + \dots + x_n), \quad x_k \in \mathbb{R}^d$$

na obje strane (2.5) dobivamo

$$(X_{t_0}, X_{t_1}, \dots, X_{t_n}) \stackrel{d}{=} (X'_{t_0}, X'_{t_1}, \dots, X'_{t_n}).$$

Preostaje (ii). Moramo definirati vjerojatnosni prostor i $\{X_t\}$ na njemu te zatim dokazati da proces ima željena svojstva. Uvedimo uobičajenu konstrukciju (npr. [Sat99, str. 4]): $\Omega = (\mathbb{R}^d)^{[0, \infty)}$, odgovarajuća σ -algebra cilindara za \mathcal{F} i za $\omega = (\omega(t))_t$ stavimo $X_t(\omega) = \omega(t)$. Za $n \in \mathbb{N}$ i $0 \leq t_0 < t_1 < \dots < t_n$ definiramo vjerojatnosnu mjeru na bazi σ -algebre $\mathcal{B}((\mathbb{R}^d)^{n+1})$

$$\begin{aligned} \mu_{t_0, \dots, t_n}(B_0 \times \dots \times B_n) &= \int_{\mathbb{R}^d} \dots \int_{\mathbb{R}^d} d\mu^{t_0}(y_0) 1_{B_0}(y_0) d\mu^{t_1-t_0}(y_1) 1_{B_1}(y_0 + y_1) \\ &\quad \dots d\mu^{t_n-t_{n-1}}(y_n) 1_{B_n}(y_0 + \dots + y_n), \end{aligned} \quad (2.6)$$

⁷njihove komponente isto mogu biti vektori, tada se radi o blok-zapisu

gdje $B_k \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$. Mjera je dobro definirana po prop. 2.4.2, t. (vi). Familija $\{\mu_{t_0, \dots, t_n}\}$ je suglasna (v. komentar 2.4.5) pa po teoremu Kolmogorova postoji jedinstvena vjerojatnosna mjera \mathbb{P} na \mathcal{F} takva da

$$\mathbb{P}(X_{t_0} \in B_0, \dots, X_{t_n} \in B_n) = \mu_{t_0, \dots, t_n}(B_0 \times \dots \times B_n).$$

Stavimo li $t_0 = t$ i $B_k = \mathbb{R}^d$ za $k \geq 1$ dobivamo da X_t ima distribuciju μ^t . Posebice, $X_0 = 0$ g.s. Za ograničenu izmjerivu funkciju f generalno vrijedi

$$\begin{aligned} \mathbb{E}f(X_0, \dots, X_n) &= \int_{\mathbb{R}^d} \dots \int_{\mathbb{R}^d} f(y_0, y_0 + y_1, \dots, y_0 + \dots + y_n) \\ &\quad d\mu^{t_0}(y_0) d\mu^{t_1-t_0}(y_1) \dots d\mu^{t_n-t_{n-1}}(y_n). \end{aligned} \quad (2.7)$$

Neka je $z = (z_1, \dots, z_n)$, $z_k \in \mathbb{R}^d$, fiksna. Definiramo

$$\begin{aligned} f(x_0, \dots, x_n) &= \exp\left(i \sum_{k=1}^n \langle z_k, x_k - x_{k-1} \rangle\right) \quad \text{i} \\ f_k(x_0, \dots, x_n) &= \exp(i \langle z_k, x_k - x_{k-1} \rangle), \quad 1 \leq k \leq n. \end{aligned}$$

Onda je $f = \prod_k f_k$ te su $\mathbb{E}f(X_0, \dots, X_n)$ i $\mathbb{E}f_k(X_0, \dots, X_n)$ vrijednosti u točki z karakterističnih funkcija od redom $(X_{t_0}, X_{t_1} - X_{t_0}, \dots, X_{t_n} - X_{t_{n-1}})$ i $X_{t_k} - X_{t_{k-1}}$. Najprije se iz (2.7) lako dobije

$$\mathbb{E}f_k(X_0, \dots, X_n) = \int_{\mathbb{R}^d} \exp(i \langle z_k, y_k \rangle) d\mu^{t_k-t_{k-1}}(y_k)$$

pa slijedi da $X_{t_k} - X_{t_{k-1}}$ ima distribuciju $\mu^{t_k-t_{k-1}}$. Dakle, dokazali smo stacionarnost. Nezavisnost dobijemo jer

$$\begin{aligned} \mathbb{E}f(X_0, \dots, X_n) &= \int_{\mathbb{R}^d} \dots \int_{\mathbb{R}^d} \exp\left(i \sum_{k=1}^n \langle z_k, y_k \rangle\right) d\mu^{t_1-t_0}(y_1) \dots d\mu^{t_n-t_{n-1}}(y_n) \\ &= \prod_{k=1}^n \mathbb{E}f_k(X_0, \dots, X_n). \end{aligned}$$

Na kraju jer $\mu_t \xrightarrow{w} \mu_0 = \delta_0$ slijedi $X_t \xrightarrow{d} 0$ i $X_t \xrightarrow{\mathbb{P}} 0$ kad $t \downarrow 0$. Zbog stacionarnosti prirasta, to se lako proširi na stohastičku neprekidnost na cijeloj domeni. Dakle, $\{X_t\}$ je Lévyjev po distribuciji. \square

Komentar 2.4.5. Razjasnimo par stvari iz dokaza teorema 2.4.4.

- Intuicija iza (2.6) je sljedeća: svakako nas zanima vjerojatnost da $x_k \in B_k$, no preostaje pitanje kako „mjeriti” pojedini skok. Dekomponiranje mjere na komponente koje ovise samo o rasponu $t_k - t_{k-1}$ i mjerenje po prirastima ($y_0 = x_0, y_k = x_k - x_{k-1}$) osiguravaju željena svojstva, a to se i potvrdi formalno.

- Obrazložimo zašto je familija mjera definiranih preko (2.6) suglasna. Kada imamo $1_{B_k} \equiv 1$ za $k < n$ dobiva se konvolucija dviju od mjera, a za $k = n$ funkcija koju integriramo više ne ovisi o y_n pa i mjera μ_n nestaje. Prikažimo prvo bez smanjenja općenitosti za $n = 2$ i $B_1 = \mathbb{R}^d$:

$$\begin{aligned} \mu_{t_0, t_1, t_2}(B_0 \times \mathbb{R}^d \times B_2) &= \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} \int_{\mathbb{R}^d} \int_{\mathbb{R}^d} 1_{B_0}(y_0) d\mu^{t_0}(y_0) 1_{B_2}(y_0 + y_1 + y_2) d\mu^{t_1-t_0}(y_1) d\mu^{t_2-t_1}(y_2) \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} \int_{\mathbb{R}^d} 1_{B_0}(y_0) d\mu^{t_0}(y_0) 1_{B_2}(y_0 + y'_2) d(\mu^{t_2-t_1} * \mu^{t_1-t_0})(y'_2) \end{aligned} \quad (2.8)$$

$$= \mu_{t_0, t_2}(B_0 \times B_2), \quad (2.9)$$

gdje $y'_2 = y_1 + y_2$, a jednakost (2.8) dobijemo preko poznate formule za konvoluciju (npr. [Sar80, §13.4, (6)]). Naime, možemo ju u našem slučaju pisati i kao:

$$\begin{aligned} \int_{\mathbb{R}^d} 1_{B_2-y_0}(y'_2) d(\mu^{t_2-t_1} * \mu^{t_1-t_0})(y'_2) \\ = \int_{\mathbb{R}^d} \int_{\mathbb{R}^d} 1_{B_2}(y_0 + y_1 + y_2) d\mu^{t_2-t_1}(y_2) d\mu^{t_1-t_0}(y_1). \end{aligned}$$

Za (2.9) nam treba i $\mu^s * \mu^t = \mu^{s+t}$ — po prop. 2.4.2 karakteristična funkcija od μ^{s+t} je $\exp[(t+s) \log \hat{\mu}]$ što je produkt karakterističnih funkcija od μ^s i μ^t .

Za kraj odjeljka vrijedi spomenuti i temu Lévy–Hinčinove reprezentacije beskonačno djeljivih distribucija odn. njihovih karakterističnih funkcija. Ona nam ovdje nije bila potrebna, no detaljno je obrađena u [Sat99, §8].

2.5 Markovljevi procesi i modifikacije

U ovom odjeljku uvodimo Markovljeve procese. Pokazuje se da su oni generalizacija Lévyjevih i aditivnih procesa, tj. Lévyjevi i aditivni procesi zadovoljavaju Markovljevo svojstvo. Zanima nas ima li Lévyjev po distribuciji proces iz teorema 2.4.4, t. (ii), modifikaciju koja je Lévyjev proces. Pitanje modifikacija s càdlàg ili neprekidnim trajektorijama promatrat ćemo na Markovljevim procesima; dovoljne uvjete dajemo u teoremu 2.5.10.

Najprije uvedimo pojam tranzicijske funkcije. Intuitivno, funkcija mjeri vjerojatnost prijelaza iz točke x u skup B između trenutaka s i t .

Definicija 2.5.1. Preslikavanje $\mathbb{P}_{s,t}(x, B)$ gdje $x \in \mathbb{R}^d$, $B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$ i $0 \leq s \leq t < \infty$ je *tranzicijska funkcija* na \mathbb{R}^d ako

- (i) za fiksni x je $B \mapsto \mathbb{P}_{s,t}(x, B)$ vjerojatnosna mjera na $\mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$,
- (ii) za fiksni B je $x \mapsto \mathbb{P}_{s,t}(x, B)$ Borel-izmjeriva,

(iii) vrijedi $\mathbb{P}_{s,s}(x, B) = \delta_x(B)$ i

(iv) zadovoljava relaciju

$$\int_{\mathbb{R}^d} \mathbb{P}_{s,t}(x, dy) \mathbb{P}_{t,u}(y, B) = \mathbb{P}_{s,u}(x, B), \quad u \geq t. \quad (2.10)$$

Dodatno, razmatramo uvjete:

(v) $\mathbb{P}_{s+h,t+h}(x, B)$ ne ovisi o h i

(vi) $\mathbb{P}_{s,t}(x, B) = \mathbb{P}_{s,t}(0, B - x)$.

Ako vrijedi (v) kažemo da je tranzicijska funkcija *vremenski homogena*. Ako vrijedi (vi) kažemo da je *prostorno homogena* ili *invarijantna na translaciju*.

Komentar 2.5.2. • Jednakost (2.10) zove se identitet Chapman–Kolmogorova.

- Ako familiju $\{\mathbb{P}_{s,t} : 0 \leq s \leq t\}$ čine vremenski homogene tranzicijske funkcije, označavamo ju s $\{\mathbb{P}_t : t \geq 0\}$ gdje $\mathbb{P}_t = \mathbb{P}_{0,t}$.

Komentar 2.5.3. Za familiju $\{\mathbb{P}_{s,t}\}$ tranzicijskih funkcija i početnu vrijednost $a \in \mathbb{R}^d$ možemo konstruirati proces $\{Y_t\}$ kako slijedi. Tehnika i ideje slične su kao u dokazu teorema 2.4.4 pa ćemo biti manje detaljni. Definiramo na uobičajeni način Ω , \mathcal{F} i $\{Y_t\}$. Za $0 \leq t_1 < \dots < t_n$ i $B_0, \dots, B_n \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$ definiramo vjerojatnosnu mjeru preko

$$\begin{aligned} \mu_{t_0, \dots, t_n}^{(a)}(B_0 \times \dots \times B_n) \\ = \int_{\mathbb{R}^d} \dots \int_{\mathbb{R}^d} 1_{B_0}(x_0) \dots 1_{B_n}(x_n) \\ \mathbb{P}_{t_{n-1}, t_n}(x_{n-1}, dx_n) \dots \mathbb{P}_{t_0, t_1}(x_0, dx_1) \mathbb{P}_{0, t_0}(a, dx_0). \end{aligned} \quad (2.11)$$

Suglasnost takve familije slijedi iz (2.10) te se ona proširi na jedinstvenu vjerojatnosnu mjeru \mathbb{P}^a na \mathcal{F} .

Slična konstrukcija moguća je za drukčije početno vrijeme $s > 0$. Tada $\Omega^s = (\mathbb{R}^d)^{[s, \infty)}$ i definiramo proces $\{Y_t : t \geq s\}$. Familija mjera

$$\left\{ \mu_{t_0, \dots, t_n}^{(s, a)} : s \leq t_0 < \dots < t_n \right\}$$

definira se analogno kao u (2.11) i proširi se na jedinstvenu vjerojatnosnu mjeru $\mathbb{P}^{s, a}$ na σ -algebri \mathcal{F}^s . Možemo iste oznake s $s = 0$ koristiti za objekte iz prošlog paragrafa.

Definicija 2.5.4. Slučajni proces $\{X_t\}$ definiran na vjerojatnosnom prostoru $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$ je *Markovljev proces sa familijom tranzicijskih funkcija* $\{\mathbb{P}_{s,t}\}$ i *početnom vrijednosti* a ako je po distribuciji jednak procesu $\{Y_t : t \geq 0\}$ definiranom u komentaru 2.5.3. Ako su tranzicijske funkcije vremenski homogene, i sam proces naziva se *vremenski homogenim*. Analogno, za proces $\{X_t : t \geq s\}$ jednak po distribuciji procesu $\{Y_t : t \geq s\}$ na prostoru $(\Omega^s, \mathcal{F}^s, \mathbb{P}^{s, a})$ može se dodati da ima *početno vrijeme* s . Procesi $\{Y_t\}$ zovu se *trajektorijska reprezentacija*.

Vezu Markovljevih s aditivnim i Lévyjevim procesima možemo ukratko i pomalo neprecizno (v. [Sat99, §10]) rezimirati ovako:

- aditivni (po distribuciji) proces odgovara Markovljevom procesu s prostorno homogenom tranzicijskom funkcijom i
- Lévyjev (po distribuciji) proces odgovara Markovljevom procesu s prostorno i vremenski homogenom tranzicijskom funkcijom.

Sljedeća propozicija uvodi varijantu Markovljevog svojstva za ovu vrstu procesa. Većina dokaza je tehnička i temelji se na Lebesgueovoj indukciji pa ga izostavljamo, ali neke stvari pojašnjavamo u komentaru 2.5.6.

Propozicija 2.5.5. *Neka je $\{Y_t\}$ trajektorijska reprezentacija Markovljevog procesa s familijom tranzicijskih funkcija $\{\mathbb{P}_{s,t}\}$. Neka su $0 \leq t_0 < \dots < t_n$ i f ograničena Borel-izmjeriva funkcija na \mathbb{R}^d . S $\mathbb{E}^{s,a}$ označimo matematičko očekivanje s obzirom na vjerojatnosnu mjeru $\mathbb{P}^{s,a}$. Tada je $a \mapsto \mathbb{E}^{0,a}[f(Y_{t_0}, \dots, Y_{t_n})]$ Borel-izmjeriva za sve $a \in \mathbb{R}^d$ i*

$$\begin{aligned} & \mathbb{E}^{0,a}[f(Y_{t_0}, \dots, Y_{t_n})] \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} \dots \int_{\mathbb{R}^d} f(x_0, \dots, x_n) \\ & \quad \mathbb{P}_{t_{n-1}, t_n}(x_{n-1}, dx_n) \dots \mathbb{P}_{t_0, t_1}(x_0, dx_1) \mathbb{P}_{0, t_0}(a, dx_0). \end{aligned} \quad (2.12)$$

Nadalje, ako su $0 \leq s_0 < \dots < s_m \leq s$ i g ograničena Borel-izmjeriva funkcija na \mathbb{R}^d vrijedi⁸

$$\begin{aligned} & \mathbb{E}^{0,a}[g(Y_{s_0}, \dots, Y_{s_m}) f(Y_{s+t_0}, \dots, Y_{s+t_n})] \\ &= \mathbb{E}^{0,a}[g(Y_{s_0}, \dots, Y_{s_m}) \mathbb{E}^{s, Y_s}[f(Y_{s+t_0}, \dots, Y_{s+t_n})]]. \end{aligned} \quad (2.13)$$

Komentar 2.5.6. Relacija (2.13) zove se Markovljevo svojstvo. Objasnimo prvo bazu Lebesgueove indukcije u dokazu (2.13). Uzimamo

$$f = \prod_{k=0}^n 1_{B_k} \quad \text{ i } \quad g = \prod_{k=0}^m 1_{C_k},$$

gdje su $B_0, \dots, B_n, C_0, \dots, C_m$ Borelovi. Raspišemo li lijevu stranu od (2.13) preko (2.12) dobivamo da je jednaka

$$\mathbb{P}^{0,a}(Y_{s_0} \in C_0, \dots, Y_{s_m} \in C_m, Y_{s+t_0} \in B_0, \dots, Y_{s+t_n} \in B_n). \quad (2.14)$$

zbog (2.11). U (2.14) dodamo još $Y_s \in \mathbb{R}^d$ prije nego raspišemo po (2.11). Unutarnjih $n+1$ integrala je jednako

$$\begin{aligned} & \int_{\mathbb{R}^d} \int_{\mathbb{R}^d} \dots \int_{\mathbb{R}^d} \prod_{k=0}^n 1_{B_k}(y_k) \mathbb{P}_{s+t_{n-1}, s+t_n}(y_{n-1}, dy_n) \\ & \quad \dots \mathbb{P}_{s+t_0, s+t_1}(y_0, dy_1) \mathbb{P}_{s, s+t_0}(y_s, dy_0), \end{aligned}$$

⁸ $\mathbb{E}^{s, Y_s}[\cdot]$ znači $h(Y_s)$ gdje je $h(x) = \mathbb{E}^{s, x}[\cdot]$

što po (2.12) i (2.11) za opći s prepoznavamo kao $\mathbb{E}^{s, y_s}[f(Y_{s+t_0}, \dots, Y_{s+t_n})]$. Uvrštavanjem natrag u raspis opet primijenimo (2.12) da zaključimo da je upravo riječ o desnoj strani u (2.13).

Intuitivno, Markovljevo svojstvo govori da budućnost ovisi samo o trenutnom stanju procesa, a ne i o prošlima. Preciznije, za predvidjeti budućnost jednako je korisna sadašnjost koliko i svi dosad poznati događaji. Pokažimo kako to doista slijedi iz (2.13). Fiksirajmo s, t_0, \dots, t_n , uvedimo pokrate $X = f(Y_{s+t_0}, \dots, Y_{s+t_n})$ i $h(x) = \mathbb{E}^{s, x}(X)$ te definirajmo σ -algebru

$$\mathcal{F}_s = \sigma(Y_t : 0 \leq t \leq s).$$

Razmotrimo i skup

$$G = \{g(Y_{s_0}, \dots, Y_{s_m}) : 0 \leq s_0 < \dots < s_m \leq s, g \text{ Borelova i ograničena}\}. \quad (2.15)$$

Kad bismo u (2.15) izostavili uvjet da je g ograničena bio bi G jednak skupu svih \mathcal{F}_s -izmjerivih varijabli (v. [Sar80, tm. 8.6]). Ipak, budući da svaku g možemo dobiti kao limes ograničenih, lako je dokazati da $\sigma(G) = \mathcal{F}_s$. U novim oznakama (2.13) postaje

$$\mathbb{E}^{0, a}[ZX] = \mathbb{E}^{0, a}[Zh(Y_s)], \quad Z \in G,$$

što se istim principom proširuje na sve Z izmjerive u \mathcal{F}_s . Budući da je $h(Y_s)$ očito izmjeriva u \mathcal{F}_s , po definiciji uvjetnog očekivanja (v. [Sar80, str. 579]) zaključujemo da je $h(Y_s) = \mathbb{E}^{0, a}[X | \mathcal{F}_s]$. No, $h(Y_s)$ je izmjeriva i u $\sigma(Y_s)$ te zbog $\sigma(Y_s) \subseteq \mathcal{F}_s$ opet po definiciji $h(Y_s) = \mathbb{E}^{0, a}[X | Y_s]$. Dakle,

$$\mathbb{E}^{0, a}[X | \mathcal{F}_s] = \mathbb{E}^{0, a}[X | Y_s].$$

Analogno prethodnoj diskusiji, X se može zamijeniti bilo kojom varijablom izmjerivom u $\sigma(Y_t : t \geq s)$. Zbog te općenitosti dobivamo i

$$\mathbb{P}^{0, a}[X \in A | \mathcal{F}_s] = \mathbb{P}^{0, a}[X \in A | Y_s], \quad A \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^d).$$

Sada možemo krenuti prema glavnom rezultatu odjeljka. Definirajmo najprije nekoliko novih pojmova. Za $x \in \mathbb{R}^d$ neka je $K_\varepsilon(x)$ ε -okolina točke x , tj.⁹ $K_x(\varepsilon) = \{y \in \mathbb{R}^d : |y - x| < \varepsilon\}$. Neka su $\mathbb{P}_{s, t}$ tranzicijske funkcije na \mathbb{R}^d . Definiramo

$$\alpha_{\varepsilon, T}(u) = \sup\{\mathbb{P}_{s, t}(x, K_\varepsilon^c(x)) : x \in \mathbb{R}^d, s, t \in [0, T], 0 \leq t - s \leq u\}. \quad (2.16)$$

Nadalje neka je $M \subseteq [0, \infty)$. Za fiksni ω kažemo da $X_t(\omega)$ ima ε -oscilaciju n puta u M ako postoje $t_0 < \dots < t_n$ gdje $t_k \in M$ takvi da

$$|X_{t_k}(\omega) - X_{t_{k-1}}(\omega)| > \varepsilon, \quad 1 \leq k \leq n.$$

⁹zapis implicira da je $|\cdot|$ norma na \mathbb{R}^d — kako su sve norme ekvivalentne na konačnodimenzi-onalnom vektorskom prostoru, odabir nije bitan

Ako tvrdnja vrijedi za sve $n \in \mathbb{N}$, kažemo da ima *beskonačno čestu ε -oscilaciju*. Definiramo još

$$\begin{aligned}\Omega_2 &= \{\omega \in \Omega : \lim_{s \in \mathbb{Q}, s \downarrow t} X_s(\omega) \text{ postoji u } \mathbb{R}^d \text{ za sve } t \geq 0 \text{ i} \\ &\quad \lim_{s \in \mathbb{Q}, s \uparrow t} X_s(\omega) \text{ postoji u } \mathbb{R}^d \text{ za sve } t > 0\}, \\ A_{N,k} &= \{\omega \in \Omega : X_t(\omega) \text{ nema beskonačno čestu } \frac{1}{k}\text{-oscilaciju u } [0, N] \cap \mathbb{Q}\}, \\ \Omega'_2 &= \bigcap_{N=1}^{\infty} \bigcap_{k=1}^{\infty} A_{N,k}, \\ B(p, \varepsilon, M) &= \{\omega \in \Omega : X_t(\omega) \text{ ima } \varepsilon\text{-oscilaciju } p \text{ puta u } M\}.\end{aligned}$$

Pokaže se $\Omega'_2 \in \mathcal{F}$. Prije glavnog rezultata, potrebno nam je nekoliko lema.

Lema 2.5.7. *Vrijedi $\Omega'_2 \subseteq \Omega_2$.*

Dokaz. Neka je $\omega \in \Omega'_2$ i pretpostavimo da ne postoji limes zdesna u $t \geq 0$ (analogno za limes slijeva). To znači da postoji niz $(s_n)_n$ racionalnih brojeva takvih da $s_n \downarrow t$ i da ne postoji limes $\lim_n X_{s_n}(\omega)$. To znači da niz $(X_{s_n}(\omega))_n$ nije Cauchyjev tj. postoji $\varepsilon > 0$ takav da

$$(\forall n_0 \in \mathbb{N})(\exists m, n \geq n_0 \text{ takvi da } |X_{s_n}(\omega) - X_{s_m}(\omega)| > 2\varepsilon). \quad (2.17)$$

Naći ćemo beskonačno čestu ε -oscilaciju i time kontradikciju. Neka je $s'_1 = s_n$ proizvoljan. Tvrdimo da postoji $s'_2 = s_m$ gdje $m > n$ takav da $|X_{s'_1}(\omega) - X_{s'_2}(\omega)| > \varepsilon$. U suprotnom bi bilo

$$\begin{aligned}|X_{s_m}(\omega) - X_{s_k}(\omega)| &\leq |X_{s_m}(\omega) - X_{s'_1}(\omega)| + |X_{s'_1}(\omega) - X_{s_k}(\omega)| \\ &\leq \varepsilon + \varepsilon = 2\varepsilon,\end{aligned}$$

za sve $m, k > n$ što je u kontradikciji s (2.17). Iteriranjem ovog postupka dolazimo do niza $(s'_n)_n$ takvog da $|X_{s'_k}(\omega) - X_{s'_{k+1}}(\omega)| > \varepsilon$ za $k \in \mathbb{N}$. \square

Lema 2.5.8. *Ako je $\{X_t\}$ stohastički neprekidan i $\mathbb{P}(\Omega'_2) = 1$, tada ima modifikaciju $\{X'_t\}$ takvu da je $t \mapsto X'_t(\omega)$ càdlàg za svaki $\omega \in \Omega$.*

Dokaz. Definiramo

$$X'_t(\omega) = \begin{cases} \lim_{s \in \mathbb{Q}, s \downarrow t} X_s(\omega), & \omega \in \Omega'_2, \\ 0, & \omega \notin \Omega'_2. \end{cases}$$

Dokažimo da je $t \mapsto X'_t(\omega)$ neprekidna zdesna. Za $\omega \notin \Omega'_2$ je očito, pa neka $\omega \in \Omega'_2$. Neka je $t \geq 0$ proizvoljan i $(t_n)_n$ takav da $t_n \downarrow t$. Za svaki $n \in \mathbb{N}$ definiramo $\delta_n > 0$ takav da $t_n + \delta_n \in \mathbb{Q}$ i takav da desna strana u

$$|X'_t(\omega) - X'_{t_n}(\omega)| \leq |X'_t(\omega) - X_{t_n + \delta_n}(\omega)| + |X_{t_n + \delta_n}(\omega) - X'_{t_n}(\omega)|$$

teži k nuli kad $n \rightarrow \infty$. Jasno je da je to moguće po definiciji skupa $\Omega_2 \supseteq \Omega'_2$. Time smo dokazali neprekidnost zdesna, a postojanje limesa slijeva dokaže se sličnom tehnikom.

Preostaje dokazati da je $\{X_t\}$ doista modifikacija polaznog procesa. Neka je $t \geq 0$ i $(s_n)_n$ niz racionalnih brojeva takav da $s_n \downarrow t$. Po stohastičkoj neprekidnosti je $X_{s_n} \xrightarrow{\mathbb{P}} X_t$, a po definiciji procesa $\{X'_t\}$ i $\mathbb{P}(\Omega'_2) = 1$ vrijedi $X_{s_n} \xrightarrow{g, s_n} X'_t$. Slijedi $\mathbb{P}(X_t = X'_t) = 1$. \square

Lema 2.5.9. *Neka je $p \in \mathbb{N}$,*

$$0 \leq s_1 < \dots < s_m \leq u \leq t_1 < \dots < t_n \leq v \leq T$$

i $M = \{t_1, \dots, t_n\}$. Ako je $\{X_t\}$ Markovljev proces s familijom tranzicijskih funkcija $\{\mathbb{P}_{s,t}\}$ i početnom vrijednosti a , tada

$$\mathbb{E}^{0,a}[Z \cdot 1_{B(p,4\varepsilon,M)}] \leq \mathbb{E}^{0,a}[Z](2\alpha_{\varepsilon,T}(v-u))^p,$$

za svaku $Z = g(X_{s_1}, \dots, X_{s_m})$, gdje je g Borelova i nenegativna.

Dokaz. Pretpostavimo bez smanjenja općenitosti da je $\{X_t\}$ sam trajektorijska reprezentacija. Tvrdnju dokazujemo indukcijom po p . Neka je $p = 1$. Definiramo događaje

$$\begin{aligned} C_k &= \{|X_{t_j} - X_u| \leq 2\varepsilon, \text{ za } 1 \leq j \leq k-1 \text{ i } |X_{t_k} - X_u| > 2\varepsilon\}, \\ D_k &= \{|X_v - X_{t_k}| > \varepsilon\}, \quad 1 \leq k \leq n. \end{aligned}$$

Događaji C_k su disjunktni. Tvrdimo

$$\begin{aligned} B(1,4\varepsilon,M) &\subseteq \bigcup_{k=1}^n \{|X_{t_k} - X_u| > 2\varepsilon\} = \bigcup_{k=1}^n C_k \\ &\subseteq \{|X_u - X_v| \geq \varepsilon\} \cup \bigcup_{k=1}^n (C_k \cap D_k). \end{aligned}$$

Prva inkluzija vrijedi jer ako $\omega \in B(1,4\varepsilon,M)$ i $4\varepsilon < |X_{t_j}(\omega) - X_{t_k}| \leq |X_{t_j} - X_u| + |X_{t_k} - X_u|$ pa je barem jedan od sumanada zdesna $> 2\varepsilon$. Ako $\omega \in C_k$ iz $4\varepsilon |X_{t_j} - X_{t_k}| \leq |X_{t_j} - X_u| + |X_u - X_v| + |X_{t_k} - X_v|$ i $|X_u - X_v| < \varepsilon$ slijedi $|X_{t_k} - X_v| > \varepsilon$, stoga vrijedi druga inkluzija. Primjenom matematičkog očekivanja dobivamo

$$\begin{aligned} \mathbb{E}^{0,a}[Z \cdot 1_{B(1,4\varepsilon,M)}] &\leq \mathbb{E}^{0,a}[Z \cdot 1_{\{|X_u - X_v| \geq \varepsilon\}}] + \sum_{k=1}^n \mathbb{E}^{0,a}[Z 1_{C_k} 1_{D_k}] \\ &\leq \mathbb{E}^{0,a}[Z] \alpha_{\varepsilon,T}(v-u) + \sum_{k=1}^n \mathbb{E}^{0,a}[Z 1_{C_k}] \alpha_{\varepsilon,T}(v-u) \\ &\leq 2\mathbb{E}^{0,a}[Z] \alpha_{\varepsilon,T}(v-u), \end{aligned}$$

pri čemu drugu nejednakost dobivamo primjenom Markovljevog svojstva (2.13), nakon čega dobivenu varijablu možemo uniformno ograničiti konstantom $\alpha_{\varepsilon,T}(v-u)$ po definiciji (2.16). Time je dokazana baza indukcije.

Pretpostavimo da tvrdnja vrijedi za $p-1$ i dokažimo da vrijedi za p . Definiramo događaje

$$\begin{aligned} F_k &= \{X_t \text{ ima } 4\varepsilon\text{-oscilaciju } p-1 \text{ puta u } \{t_1, \dots, t_k\} \text{ ali ne i u } \{t_1, \dots, t_{k-1}\}\}, \\ G_k &= \{X_t \text{ ima } 4\varepsilon\text{-oscilaciju jednom u } \{t_{k+1}, \dots, t_n\}\}, \quad 1 \leq k \leq n. \end{aligned}$$

Događaji F_k su disjunktni i očito

$$B(p-1, 4\varepsilon, M) = \bigcup_{k=1}^n F_k \quad \text{ i } \quad B(p, 4\varepsilon, M) \subseteq \bigcup_{k=1}^n (F_k \cap G_k).$$

Nastavimo kao u dokazu baze te primjenom pretpostavke i slučaja $p=1$ dobivamo traženo. \square

Slijedi glavni rezultat odjeljka koji daje dovoljne uvjete da bi Markovljev proces imao modifikaciju s càdlàg odn. neprekidnim trajektorijama.

Teorem 2.5.10. *Neka je $\{X_t\}$ Markovljev proces na $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$ s familijom tranzicijskih funkcija $\{\mathbb{P}_{s,t}\}$. Ako vrijedi*

$$\lim_{u \downarrow 0} \alpha_{\varepsilon, T}(u) = 0, \quad \forall \varepsilon > 0, \quad \forall T > 0, \quad (2.18)$$

tada $\{X_t\}$ ima modifikaciju $\{X'_t\}$ takvu da je trajektorija $t \mapsto X'_t(\omega)$ càdlàg za svaki $\omega \in \Omega$. Ako vrijedi jači uvjet

$$\lim_{u \downarrow 0} \frac{1}{u} \alpha_{\varepsilon, T}(u) = 0, \quad \forall \varepsilon > 0, \quad \forall T > 0, \quad (2.19)$$

tada $\{X_t\}$ ima modifikaciju $\{X'_t\}$ takvu da postoji $\Omega_1 \in \mathcal{F}$ takav da $\mathbb{P}(\Omega_1) = 1$ i $\omega \in \Omega_1$ povlači da je trajektorija $t \mapsto X'_t(\omega)$ neprekidna.

Dokaz. Pretpostavimo prvo (2.18). Po lemi 2.5.8 dovoljno je dokazati $\mathbb{P}(\Omega'_2) = 1$, a za to je opet dovoljno $\mathbb{P}(A_{N,k}^c) = 0$ za sve $N, k \in \mathbb{N}$. Fiksirajmo N i k . Po (2.18) odaberimo ℓ takav da $2\alpha_{1/(4k), N}(N/\ell) < 1$. Definiramo $t_j = \frac{Nj}{\ell}$ za $0 \leq j \leq \ell$ i $I_j = [t_{j-1}, t_j] \cap \mathbb{Q}$ za $j > 0$. Vrijedi

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(A_{N,k}^c) &= \mathbb{P}\left(X_t \text{ ima } \frac{1}{k}\text{-oscilaciju beskonačno često u } [0, N] \cap \mathbb{Q}\right) \\ &\leq \sum_{j=1}^{\ell} \mathbb{P}\left(X_t \text{ ima } \frac{1}{k}\text{-oscilaciju beskonačno često u } I_j\right) \\ &= \sum_{j=1}^{\ell} \lim_{p \rightarrow \infty} \mathbb{P}\left[B\left(p, \frac{1}{k}, I_j\right)\right]. \end{aligned} \quad (2.20)$$

Uzmimo fiksni I_j i $\{s_1, \dots, s_n\} \subset I_j$. Po lemi 2.5.9 je

$$\mathbb{P}[B(p, 1/k, \{s_1, \dots, s_n\})] \leq \left(2\alpha_{\frac{1}{4k}, N} \left(\frac{N}{\ell}\right)\right)^p.$$

Aproksimirajući I_j odozgo konačnim skupovima ($n \rightarrow \infty$) slijedi

$$\mathbb{P}[B(p, 1/k, I_j)] \leq \left(2\alpha_{\frac{1}{4k}, N} \left(\frac{N}{\ell}\right)\right)^p,$$

što znači da (2.20) teži u 0, a stoga i $\mathbb{P}(A_{N,k}^c) = 0$ kako smo htjeli.

Pretpostavimo sada (2.19). Dovoljno je dokazati da za svaki $N \in \mathbb{N}$ postoji $H_N \in \mathcal{F}$ takav da $\mathbb{P}(H_N) = 1$ i

$$H_N \subseteq \{X'_t = X'_{t-}, \forall t \in \langle 0, N \rangle\}.$$

gdje je X'_{t-} limes slijeva u t . Neka je N fiksni i definiramo za $\ell \in \mathbb{N}$ i $\varepsilon > 0$

$$R_{\ell, \varepsilon} = \sum_{j=1}^{\ell} 1_{\{|X'_{t_j} - X'_{t_{j-1}}| > \varepsilon\}},$$

$$R_{\varepsilon}(\omega) = \text{card} \{t \in \langle 0, N \rangle : |X'_t(\omega) - X'_{t-}(\omega)| > \varepsilon\}$$

pa je $R_{\varepsilon}(\omega) \leq \liminf_{\ell \rightarrow \infty} R_{\ell, \varepsilon}(\omega)$. Vrijedi

$$\mathbb{E}(R_{\ell, \varepsilon}) = \sum_{j=1}^{\ell} \mathbb{P}(|X'_{t_j} - X'_{t_{j-1}}| > \varepsilon) \leq \ell \alpha_{\varepsilon, N} \left(\frac{N}{\ell}\right).$$

Po (2.19) imamo $\lim_{\ell \rightarrow \infty} \mathbb{E}(R_{\ell, \varepsilon}) = 0$ i po Fatouovoj lemi $\mathbb{E}\left(\liminf_{\ell \rightarrow \infty} R_{\ell, \varepsilon}\right) = 0$. Stavimo

$$H_N = \bigcap_{k=1}^{\infty} \left\{ \liminf_{\ell \rightarrow \infty} R_{\ell, 1/k} = 0 \right\}.$$

Zadovoljili smo željeni uvjet jer $H_N \subseteq \{R_{\varepsilon} = 0, \forall \varepsilon > 0\}$. □

Sada samo trebamo dokazati da Lévyjev po distribuciji proces zadovoljava (2.18) da bismo mogli pojačati teorem 2.4.4 i zaključiti da postoji 1-1 korespondencija između beskonačno djeljivih distribucija i Lévyjevih procesa. Štoviše, za aditivni proces po distribuciji, koji je Markovljev s prostorno homogenim tranzicijskim funkcijama, imamo:

$$\mathbb{P}_{s,t}(x, K_{\varepsilon}^c(x)) = \mathbb{P}_{s,t}(0, K_{\varepsilon}^c(0)) = \mathbb{P}(|X_s - X_t| > \varepsilon).$$

Slijedi $\alpha_{\varepsilon, T}(u) \rightarrow 0$ kad $u \rightarrow 0$. Za taj zaključak nam je zapravo potrebna i uniformnost stohastičke neprekidnosti na segmentu (v. [Sat99, lema 9.6]). Dakle, po teoremu 2.5.10

svaki Lévyjev po distribuciji (aditivan po distribuciji) proces ima modifikaciju s càdlàg trajektorijama, tj. koja je Lévyjev (aditivni) proces.

Na korak smo i do dokaza da Brownovo gibanje definirano preko definicije 2.3.1 postoji, no fali još svojstvo (ii) za što bismo trebali dokazati i (2.19). Pokazuje se svaki Lévyjev gaussovski (tj. takav da je svaka konačnodimenzionalna distribucija normalna; to je Brownovo gibanje do na množenje konstantom) proces u \mathbb{R} g.s. ima neprekidne trajektorije, što je tvrdnja sljedećeg teorema. Tvrdnja vrijedi i za aditivni proces u općem \mathbb{R}^d (v. [Sat99, tm. 11.7]). Čak vrijedi i obrat, tj. jedini aditivni procesi s neprekidnim trajektorijama su gaussovski (v. [Sat99, §21]).

Teorem 2.5.11. *Ako je $\{X_t\}$ Lévyjev gaussovski proces na \mathbb{R} , tada gotovo sigurno vrijedi da je trajektorija $t \mapsto X_t(\omega)$ neprekidna, tj. postoji $\Omega_1 \in \mathcal{F}$ takav da $\mathbb{P}(\Omega_1) = 1$ i $\omega \in \Omega_1$ povlači da je trajektorija $t \mapsto X_t(\omega)$ neprekidna.*

Dokaz. Neka je bez smanjenja općenitosti $X_1 \sim N(0, 1)$. Ocjenu

$$\int_c^\infty e^{-\frac{x^2}{2}} dx \leq \int_c^\infty e^{-\frac{x^2}{2}} \left(1 + \frac{1}{x^2}\right) dx = \frac{1}{c} e^{-\frac{c^2}{2}}, \quad c > 0,$$

gdje se jednakost dobije direktno antiderivacijom, iskoristimo za

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(|X_s| > \varepsilon) &= \frac{2}{\sqrt{2\pi}s} \int_\varepsilon^\infty e^{-\frac{x^2}{2s}} dx \\ &= \frac{2}{\sqrt{2\pi}} \int_{\varepsilon/\sqrt{s}}^\infty e^{-\frac{x^2}{2}} dx \leq \frac{2\sqrt{s}}{\varepsilon\sqrt{2\pi}} e^{-\frac{\varepsilon^2}{2s}}. \end{aligned}$$

Stoga,

$$\frac{1}{u} \alpha_{\varepsilon, T}(u) = \frac{1}{u} \sup_{s \leq u, T} \mathbb{P}(|X_s| > \varepsilon) \leq \sup_{s \leq u, T} \frac{1}{s} \mathbb{P}(|X_s| > \varepsilon) \rightarrow 0, \quad u \downarrow 0,$$

čime smo dokazali (2.19). □

2.6 Samosličnost

U ovom odjeljku formalno uvodimo pojam samosličnosti slučajnih procesa koji smo najavili još u uvodu. Za Brownovo gibanje vidjeli smo to svojstvo u teoremu 2.3.2. Osim o samosličnosti, govori se i o nekoliko generalizacija.

Definicija 2.6.1. Kažemo da je slučajni proces $\{X_t\}$ na \mathbb{R}^d :

- *samosličan* ako za svaki $a > 0$ postoji $b > 0$ takav da

$$\{X_{at}\} \stackrel{d}{=} \{bX_t\}, \quad (2.21)$$

- *samosličan u širem smislu* ako za svaki $a > 0$ postoje $b > 0$ i $c: [0, \infty) \rightarrow \mathbb{R}^d$ takvi da

$$\{X_{at}\} \stackrel{d}{=} \{bX_t + c(t)\}, \quad (2.22)$$

- *polu-samosličan* ako za neki $a > 0$, $a \neq 1$, postoji $b > 0$ takav da vrijedi (2.21),
- *polu-samosličan u širem smislu* ako za neki $a > 0$, $a \neq 1$, postoji $b > 0$ i $c: [0, \infty) \rightarrow \mathbb{R}^d$ takvi da vrijedi (2.22).

Sljedeći teorem je fundamentalan za samosličnost i generalizacije.

Teorem 2.6.2. *Neka je $\{X_t\}$ polu-samosličan u širem smislu, stohastički neprekidan i netrivialan¹⁰ proces na \mathbb{R}^d s X_0 g.s. konstantom. Neka je Γ skup svih a takvih da postoje b i c takvi da vrijedi (2.22).*

(i) *Postoji $H > 0$ takav da*

$$b = a^H, \quad a \in \Gamma. \quad (2.23)$$

(ii) *Skup $\Gamma \cap \langle 1, \infty \rangle$ je neprazan. Neka je a_0 infimum tog skupa.*

- *Ako je $a_0 > 1$ je $\Gamma = \{a_0^n : n \in \mathbb{Z}\}$ i $\{X_t\}$ nije samosličan u širem smislu.*
- *Ako je $a_0 = 1$ je $\Gamma = \langle 0, \infty \rangle$ i $\{X_t\}$ je samosličan u širem smislu.*

EkspONENT H iz (2.23) je važna karakteristika samosličnog slučajnog procesa. Naziva se i Hurstov eksponent. Kada ga želimo naglasiti govorimo o H -samosličnim procesima. Dokazat ćemo manje općenitu verziju teorema, a za to nam je najprije potrebna sljedeća jednostavna lema.

Lema 2.6.3. *Neka je X ne-nul slučajna varijabla na \mathbb{R}^d . Ako je $b_1X \stackrel{d}{=} b_2X$ za neke $b_1, b_2 > 0$, onda $b_1 = b_2$.*

Dokaz. Neka je $b_1 < b_2$ bez smanjenja općenitosti i $b = b_1/b_2 < 1$. Tada je $X \stackrel{d}{=} bX$ i induktivno $X \stackrel{d}{=} b^nX$ za sve $n \in \mathbb{N}$. Puštanjem $n \rightarrow \infty$ dobivamo $X = 0$ g.s. s kontradikcijom. \square

Teorem 2.6.4. *Neka je $\{X_t\}$ samosličan, stohastički neprekidan i netrivialan slučajni proces. Tada postoji $H \geq 0$ takav da vrijedi $b = a^H$ za sve a, b iz (2.21).*

Dokaz. Neka je t takav da je X_t ne-nul varijabla. Ako $b_1X_t \stackrel{d}{=} X_{at} \stackrel{d}{=} b_2X_t$ po lemi 2.6.3 slijedi $b_1 = b_2$. Dakle, b u (2.21) je jedinstveno određen s a i možemo ga označavati $b(a)$ (isto se pokazuje da vrijedi za c iz (2.22)). Nadalje vrijedi

$$X_{a_1a_2t} \stackrel{d}{=} b(a_1)X_{a_2t} \stackrel{d}{=} b(a_1)b(a_2)X_t,$$

¹⁰slučajna varijabla je trivijalna ako $\mathbb{P}(X = c) = 1$ za neki c , slučajni proces $\{X_t\}$ je trivijalan ako je svaka X_t trivijalna

ali jasno i $X_{a_1 a_2 t} = b(a_1 a_2) X_t$ iz čega slijedi $b(a_1 a_2) = b(a_1) b(a_2)$. Stoga $X_{a^n t} \stackrel{d}{=} b(a)^n X_t$. Za $a < 1$ po stohastičkoj neprekidnosti $X_{a^n t} \xrightarrow{\mathbb{P}} X_0$ i zato $b(a) \leq 1$. Ako $a_1 < a_2$ je $1 \geq b(a_1/a_2) = b(a_1)/b(a_2)$, tj. $b(a_1) \leq b(a_2)$. Dakle, $a \mapsto b(a)$ je multiplikativna i neopadajuća. Poznato je da je rješenje takve funkcijske jednadžbe dano s $b(a) = a^H$ za neki fiksni $H \geq 0$. \square

Komentar 2.6.5. Pojasnimo slučaj $H = 0$ i diskrepanciju između teorema 2.6.2 i 2.6.4. Ako $H = 0$ je $\{X_{at}\} \stackrel{d}{=} \{X_t\}$ za svaki $a > 0$. Za svaki $t \geq 0$ posebice $X_t - X_0 \stackrel{d}{=} X_{at} - X_0$. Onda i

$$\mathbb{P}(|X_t - X_0| > \varepsilon) = \lim_{a \downarrow 0} \mathbb{P}(|X_{at} - X_0| > \varepsilon) = 0, \quad \varepsilon > 0,$$

pri čemu druga jednakost vrijedi zbog stohastičke neprekidnosti. Zbog proizvoljnosti ε , slijedi $X_t = X_0$ g.s. Kada bismo još zahtijevali da je X_0 g.s. konstanta kao u teoremu 2.6.2, bio bi proces $\{X_t\}$ trivijalan.

Obratno, ako je $H > 0$ stavimo $t = 0$ pa $X_0 \stackrel{d}{=} a^H X(0)$, i uz $a \downarrow 0$ dobivamo $X_0 = 0$ g.s. Zbog tih činjenica kod samosličnih procesa često podrazumijevamo stohastičku neprekidnost i $H > 0$.

Kada je riječ o samosličnim Lévyjevim procesima, koristimo i sljedeće pojmove.

Definicija 2.6.6. Kažemo da je beskonačno djeljiva distribucija μ na $\mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$:

- *strogo stabilna* ako za svaki $a > 0$ postoji $b > 0$ takav da

$$\hat{\mu}(z)^a = \hat{\mu}(bz), \quad z \in \mathbb{R}^d, \quad (2.24)$$

- *stabilna* ako za svaki $a > 0$ postoje $b > 0$ i $c \in \mathbb{R}^d$ takvi da

$$\hat{\mu}(z)^a = \hat{\mu}(bz) e^{i\langle c, z \rangle}, \quad z \in \mathbb{R}^d, \quad (2.25)$$

- *strogo polu-stabilna* ako za neki $a > 0$, $a \neq 1$, postoji $b > 0$ takav da vrijedi (2.24),
- *polu-stabilna* ako za neki $a > 0$, $a \neq 1$, postoje $b > 0$ i $c \in \mathbb{R}^d$ takvi da vrijedi (2.25).

Kažemo da je Lévyjev proces strogo stabilan ili dr. ako je to distribucija \mathbb{P}_{X_1} . Lako je dokazati da je Lévyjev proces strogo stabilan, stabilan, strogo polu-stabilan ili polu-stabilan ako i samo ako je redom samosličan, samosličan u širem smislu, polu-samosličan ili polu-samosličan u širem smislu. U [EM02, §1.4] navodi se rezultat analogan teoremu 2.6.2: u (2.24) i (2.25) vrijedi $b = a^{1/\alpha}$ za neki fiksni $\alpha \in (0, 2]$. Za takav α onda se lako pokaže $H = 1/\alpha \geq 1/2$. Parametar α zove se *indeks*, a za proces se kaže da je α -stabilan ili α -polu-stabilan i sl.

Primjerice, lako se vidi da su normalna ($\alpha = 2$) i Cauchyjeva ($\alpha = 1$) distribucija stabilne. Standardna normalna i Cauchyjeva su štoviše strogo stabilne. Sve stabilne distribucije moguće je karakterizirati preko četiriju parametara što je tema u [Sat99, §14]. Zato se često govori o *stabilnoj distribuciji* umjesto *stabilnim distribucijama*.

Svaki samoslični proces sa stacionarnim i nezavisnim prirastima, podrazumijevajući stohastičku neprekidnost i $X_0 = 0$ g.s. (v. komentar 2.6.5) je Lévyjev strogo stabilni proces (uz ev. modifikaciju; odjeljak 2.5). Ipak, nisu svi samoslični procesi Lévyjevi, pa se proučavaju odvojeno samoslični procesi čiji su prirasti jedino stacionarni odn. jedino nezavisni (v. [EM02]).

U slučaju samosličnih procesa sa stacionarnim prirastima, možemo naći vezu s fenomenom *dugoročne zavisnosti* (pamćenja; [EM02, §3.2]), koja se konkretno definira sporim opadanjem autokovarijacijske funkcije. Stavimo $J_n = X_{n+1} - X_n$ za $n \in \mathbb{N}_0$ i $\gamma(n) = \mathbb{E}(J_0 J_n)$. U analizi stacionarnih nizova često nam je poželjan uvjet

$$\sum_n |\gamma(n)| < \infty,$$

koji zovemo *kratkoročna zavisnost* te se javlja npr. kod ARMA modela. S druge strane, dokazat ćemo da za $H > 1/2$ red ne konvergira. Osim toga, $H > 1/2$ i $H < 1/2$ impliciraju da su prirasti redom pozitivno odn. negativno korelirani. Najprije, potrebna nam je sljedeća lema.

Lema 2.6.7. *Neka je $\{X_t\}$ H -samosličan slučajni proces sa stacionarnim prirastima u \mathbb{R} i $\mathbb{E}X_1^2 < \infty$. Tada vrijedi*

$$\mathbb{E}(X_t X_s) = \frac{1}{2} \left(t^{2H} + s^{2H} - |t - s|^{2H} \right) \mathbb{E}X_1^2, \quad t, s \geq 0.$$

Dokaz. Iz samosličnosti $X_t \stackrel{d}{=} t^H X_1$, stoga $\mathbb{E}X_t^2 = t^{2H} \mathbb{E}X_1^2$. Zatim

$$\begin{aligned} 2\mathbb{E}(X_t X_s) &= \mathbb{E}X_t^2 + \mathbb{E}X_s^2 - \mathbb{E}(X_t - X_s)^2 \\ &= \mathbb{E}X_t^2 + \mathbb{E}X_s^2 - \mathbb{E}X_{|s-t|}^2 \\ &= \mathbb{E}X_1^2 \left(t^{2H} + s^{2H} - |t - s|^{2H} \right). \end{aligned}$$

□

Teorem 2.6.8. *Neka je $\{X_t\}$ H -samosličan sa stacionarnim prirastima, $0 < H < 1$, svaka X_t netrivialna i $\mathbb{E}X_1^2 < \infty$. Tada vrijedi*

$$\gamma(n) = \begin{cases} H(2H - 1)n^{2H-2}\mathbb{E}X_1^2 + o(1), & n \rightarrow \infty, \quad H \neq 1/2, \\ 0, & n \in \mathbb{N}, \quad H = 1/2. \end{cases}$$

Posljedično,

- (i) ako $H < 1/2$ je $\gamma(n) < 0$ za $n \in \mathbb{N}$ i $\sum_{n=0}^{\infty} |\gamma(n)| < \infty$,
- (ii) ako $H = 1/2$ je $\gamma(n) = 0$ za $n \in \mathbb{N}$,
- (iii) ako $H > 1/2$ je $\gamma(n) > 0$ za $n \in \mathbb{N}$ i $\sum_{n=0}^{\infty} |\gamma(n)| = \infty$.

Dokaz. Za izračunati $\gamma(n)$ prvo primijenimo lemu 2.6.7, a zatim razvijamo u Taylorov red (smijemo jer $|1/n| \leq 1$ i $2H > 0$) kako slijedi:

$$\gamma(n) = \frac{1}{2} [(n+1)^{2H} - 2n^{2H} + (n-1)^{2H}] \mathbb{E}X_1^2 \quad (2.26)$$

$$\begin{aligned} &= \frac{1}{2} n^{2H} \left[\left(1 + \frac{1}{n}\right)^{2H} - 2 + \left(1 - \frac{1}{n}\right)^{2H} \right] \mathbb{E}X_1^2 \\ &= n^{2H} \mathbb{E}X_1^2 \sum_{k=1}^{\infty} \binom{2H}{2k} \frac{1}{n^{2k}} \\ &= H(2H-1)n^{2H-2} \mathbb{E}X_1^2 + \mathbb{E}X_1^2 \sum_{k=2}^{\infty} \binom{2H}{2k} n^{2H-2k}. \end{aligned} \quad (2.27)$$

Tvrđnje za $H = 1/2$ slijede odmah iz (2.26), a inače iz (2.27): drugi sumand teži u 0 kad $n \rightarrow \infty$, ne utječe na konvergenciju niti na predznak ni za koji $n \in \mathbb{N}$.

□

Poglavlje 3

Hölder-regularnost trajektorija frakcionalnog Brownovog gibanja

3.1 Reprezentacija Brownovog gibanja slučajnim redom

U ovom poglavlju ćemo definirati frakcionalno Brownovo gibanje (FBM), koje je svojevrsna generalizacija Brownovog gibanja u kojemu ulogu $1/2$ kao parametra samosličnosti zauzima bilo koji drugi eksponent $0 < H < 1$. Nakon toga ćemo riješiti problem Hölder-regularnosti trajektorija FBM koristeći valiče za razvoj u slučajni red i time pokazati vrijednost harmonijske analize u primjeni na analizu slučajnih procesa. Pojam Hölder-regularnosti uvest ćemo sada.

Definicija 3.1.1. Za funkciju $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ kažemo da je *Hölder-regularna* s parametrom $0 < \alpha < 1$ ili da zadovoljava *Hölderov uvjet* ako

$$|f(x) - f(y)| \lesssim |x - y|^\alpha, \quad x, y \in \mathbb{R}. \quad (3.1)$$

Jasno, definiciju je moguće proširiti na funkcije na proizvoljnom metričkom prostoru. Lako se pokaže da je zahtjev (3.1) jači od uniformne neprekidnosti, ali slabiji od Lipschitz-neprekidnosti (time i diferencijabilnosti). Ideja je da se parametrom α kvantificira vrsta glatkoće slabija od diferencijabilnosti. Dobri primjer su funkcije $x \mapsto |x|^\alpha$ za $0 < \alpha < 1$ — poznato nam je da te funkcije (korijeni) nisu diferencijabilne u nuli, ali na njihovim grafovima možemo vidjeti da singularitet u nuli postaje sve manje izražen povećanjem α . Uvjet (3.1) postaje jači povećanjem α , pa nam je najzanimljiviji najveći α (supremum) za koji uvjet vrijedi — takav α zove se *kritični Hölderov eksponent*. U slučaju FBM, vidjet ćemo da parametar H odgovara tom kritičnom eksponentu. Opet, za veći eksponent trajektorija ima glađi izgled (v. [Šev15, str. 6]).

U ostatku ovog odjeljka prikazat ćemo ukratko motivacijski primjer reprezentacije Brownovog gibanja pomoću Haarovog sistema.¹ Neka je $\{B_t : t \in [0, 1]\}$ Brownovo gibanje u \mathbb{R} nad $[0, 1]$. Ono ima jednostavni prikaz pomoću Paley–Wienerovog integrala:

$$B_t = \int_0^1 1_{[0,t]}(s) dB_s.$$

Funkciju $f = 1_{[0,t]}$ želimo razviti u Haarovom sistemu. Na $L^2([0, 1])$ imamo varijantu Haarovog sistema u odnosu na $L^2(\mathbb{R})$:

$$h_0 = 1_{[0,1]}, \quad h_{j,k}(s) = 2^{j/2} h(2^j s - k), \quad j \geq 0, \quad 0 \leq k \leq 2^j - 1$$

gdje $h(s) = 1_{[0,1/2)}(s) - 1_{[1/2,1]}(s)$. Zbog jednostavnog oblika funkcija možemo direktno izračunati:

$$\langle f, h_0 \rangle = t 1_{[0,1]}, \quad \langle f, h_{j,k} \rangle = 2^{-j/2} \tau(2^j t - k), \quad j \geq 0, \quad 0 \leq k \leq 2^j - 1,$$

pri čemu je τ trokutasta funkcija na $[0, 1]$ s $\tau(1/2) = 1/2$, čime dobivamo

$$1_{[0,t]}(s) = t 1_{[0,1]}(s) + \sum_{j=0}^{\infty} \sum_{k=0}^{2^j-1} 2^{-j/2} \tau(2^j t - k) 2^{j/2} h(2^j s - k).$$

Uvrštavanjem i primjenom izometričnosti Paley–Wienerovog integrala dobivamo najavljenju reprezentaciju

$$B_t = t \varepsilon_0 + \sum_{j=0}^{\infty} \sum_{k=0}^{2^j-1} 2^{-j/2} \tau(2^j t - k) \varepsilon_{j,k}, \quad (3.2)$$

pri čemu

$$\varepsilon_0 = \int_0^1 1_{[0,1]}(s) dB_s, \quad \varepsilon_{j,k} = \int_0^1 2^{j/2} h(2^j s - k) dB_s, \quad j \geq 0, \quad 0 \leq k \leq 2^j - 1.$$

Lako je pokazati $\varepsilon_0, \varepsilon_{j,k} \sim N(0, 1)$ i da su nezavisni. Vrijedi i da red u (3.2), osim što konvergira za svaki t po normi u $L^2(\Omega)$, gotovo sigurno konvergira uniformno po t . Ovo je ujedno i temelj za Lévyjevu konstrukciju Brownovog gibanja. Definiramo li slučajni proces desnom stranom u (3.2), slijede svojstva Lévyjevog procesa (v. [Die16]), a reprezentacija je korisna i za daljnje bavljenje trajektorijama.

¹budući da ćemo na kraju doći do funkcija u tzv. Faber–Schauderovom sistemu, češće se govori o reprezentaciji Faber–Schauderovim sistemom

3.2 Frakcionalno Brownovo gibanje i integralne reprezentacije

Frakcionalno Brownovo gibanje definirat ćemo kao gaussovski proces s odgovarajućom kovarijacijskom strukturom, a zatim ispitati njegova svojstva.

Definicija 3.2.1. Neka je $H \in \langle 0, 1 \rangle$. *Frakcionalno Brownovo gibanje* (skraćeno FBM ili fBm) s parametrom H je gaussovski proces $\{B_t^H\}$ u \mathbb{R} definiran s $\mathbb{E}B_t^H = 0$ za svaki $t \geq 0$ i

$$\mathbb{E}(B_t^H B_s^H) = \frac{1}{2} \mathbb{E}[(B_1^H)^2] (t^{2H} + s^{2H} - |t - s|^{2H}), \quad t, s \geq 0. \quad (3.3)$$

Razmotrimo svojstva takvog procesa:

- Normalne konačnodimenzionalne distribucije, pa i slučajni proces, jedinstveno su (u smislu distribucije) definirani preko (3.3). Ipak, potrebno je paziti da odgovarajuće kovarijacijske matrice budu pozitivno semidefinitne. To je moguće dokazati direktno, ili je zbog leme 2.6.7 dovoljno dokazati da uopće postoji H -samosličan proces sa stacionarnim prirastima. Alternativno, FBM se može definirati tzv. integralnim reprezentacijama kojima ćemo se baviti vrlo skoro.
- Lako se dobije $B_0^H = 0$ g.s. i s tim je (3.3) ekvivalentno sa

$$\mathbb{E}[(B_t^H - B_s^H)^2] = \mathbb{E}[(B_1^H)^2] |t - s|^{2H}. \quad (3.4)$$

- Varijacija na definiciju 3.2.1 moguća je ako dodatno pretpostavimo $\text{Var } B_1^H = 1$ kao npr. u [Šev15], čime nestaje faktor $\mathbb{E}[(B_1^H)^2]$ u (3.3).
- Ako uzmemo $\text{Var } B_1^H = 1$ i $H = 1/2$, riječ je o običnom Brownovom gibanju. Naime, dobije se $\mathbb{E}(B_t^H B_s^H) = \min\{t, s\}$, što se lako pokaže da vrijedi i za Brownovo gibanje.
- Za $H = 1$ dobio bi se degenerirani slučaj — kao u dokazu teorema 2.6.8 dobili bismo $\gamma(n) = \mathbb{E}[(B_1^H)^2]$, tj. autokorelacija je uvijek 1 i $B_t^H = tB_1^H$ g.s.
- Za svaki gaussovski H -samoslični proces sa stacionarnim prirastima nužno vrijedi (3.3) po lemi (2.6.7). Dakle, ako takav proces postoji je jednak FBM.
- Za $H \neq 1/2$ prirasti nisu nezavisni po teoremu 2.6.8, što znači da FBM nije Lévyjev proces. Štoviše, nije ni aditivan ni Markovljev (v. [Šev15]).
- FBM g.s. ima neprekidne i nigdje-diferencijabilne trajektorije. Te tvrdnje slijedit će kad riješimo pitanje Hölder-regularnosti trajektorija.

- FBM je H -samoslično. Za $a > 0$ vrijedi:

$$\begin{aligned}\mathbb{E}(B_{at}^H B_{as}^H) &= \frac{1}{2} \text{Var } B_1^H [(at)^{2H} + (as)^{2H} - (a|t-s|)^{2H}] \\ &= a^{2H} \mathbb{E}(B_t^H B_s^H) = \mathbb{E}[(a^H B_t^H)(a^H B_s^H)].\end{aligned}$$

Ponovo jer kovarijacijska struktura određuje gaussovski proces, slijedi

$$\{B_{at}^H\} \stackrel{d}{=} \{a^H B_t^H\}.$$

- FBM ima stacionarne priraste. Tvrdnja se opet dobije direktno preko (3.3). Time smo dokazali sljedeću propoziciju.

Propozicija 3.2.2. *Za dani $H \in \langle 0, 1 \rangle$ je FBM jedinstveni (do na množenje konstantom; u smislu distribucije) centrirani gaussovski H -samoslični proces sa stacionarnim prirastima.*

Sada ćemo prijeći na temu integralnih reprezentacija FBM. Općenito, pod izrazom integralna reprezentacija podrazumijevamo prikaz slučajnog procesa stohastičkim integralom nekog drugog procesa (ili determinističke funkcije). U ovom radu uvijek je riječ o integralu determinističke funkcije s obzirom na Brownovo gibanje — dakle o Paley–Wienerovom integralu. Konkretno, želimo prikaz oblika

$$B_t^H \stackrel{d}{=} \int_0^t K(u) dB_u \quad \text{ili općenitije} \quad B_t^H \stackrel{d}{=} \int_{\mathbb{R}} K_t(u) dB_u \quad (3.5)$$

za $K, K_t \in L^2(\mathbb{R})$ determinističke integralne jezgre. Primijetimo da u desnoj varijanti (3.5) trebamo Brownovo gibanje za $t \in \mathbb{R}$, što dobijemo npr. spajanjem dva nezavisna Brownova gibanja $\{B_t : t \geq 0\}$ i $\{B_{-t} : t \geq 0\}$.

Slučajni proces definiran kao u (3.5) nužno je centriran i gaussovski. Neka su dani trenuci $s_1 < t_1 \leq s_2 < t_2 \leq \dots \leq s_n < t_n$, realni brojevi a_1, \dots, a_n i step-funkcija h dana s

$$h(u) = \sum_{k=1}^n a_k 1_{[s_k, t_k]}(u), \quad \text{dakle} \quad I(h) = \int_{\mathbb{R}} h(u) dB_u = \sum_{k=1}^n a_k (B_{t_k} - B_{s_k}).$$

Trivijalna je centriranost tj. $\mathbb{E}I(h) = 0$. Da je $I(h)$ normalno distribuiran slijedi jer je suma nezavisnih normalnih varijabli iz familije $\{B_{t_k} - B_{s_k} : k = 1, \dots, n\}$ uz skaliranja s a_k . Nezavisnost i normalnost vrijedi jer je riječ o prirastima Brownovog gibanja. Oba svojstva će se prenijeti na opću $h \in L^2(\mathbb{R})$ kao limes step-funkcija. Zbog dokazanog svojstva, dovoljno je dokazati (3.3) ili (3.4) da bismo dokazali da je s (3.5) doista dano FBM (iako, takav dokaz ne govori kako do dotične reprezentacije možemo doći).

Do kraja odjeljka prikazat ćemo dvije takve reprezentacije — prva je *Mandelbrot–van Nessova* ili (*non-anticipative*) *moving average*, druga se naziva *harmonizabilna* i ona će nam jedina biti potrebna u daljnjem radu. Još jedna, *Volterrinog tipa* može se naći u [Šev15], a od interesa je jer njena jezgra ima kompaktni nosač. U literaturi se uvijek dodaju uz integral i konstante potrebne za normalizaciju varijance. Budući da nam normalizirana varijanica nije bitna, niti ju tražimo u definiciji 3.2.1, konstante ćemo izostaviti. Ipak, vidljive su iz računa i mogu se naći u [Šev15].

Teorem 3.2.3. (Mandelbrot–van Nessova reprezentacija FBM). Neka je $H \in \langle 0, 1 \rangle$ ²

$$K_t(u) = (t - u)_+^{H-1/2} 1_{\langle -\infty, 0 \rangle}(u) - (-u)_+^{H-1/2}, \quad t \geq 0.$$

Tada je $\{X_t\}$, definiran s $X_t = I(K_t)$, FBM s parametrom H .

Dokaz. Neka je bez smanjenja općenitosti $t > s \geq 0$. Dokazujemo (3.4). Prvu jednakost dobivamo zbog linearnosti i izometričnosti Paley–Wienerovog integrala:

$$\begin{aligned} \mathbb{E} \left[(X_t - X_s)^2 \right] &= \int_{\mathbb{R}} \left[(t - u)_+^{H-1/2} - (s - u)_+^{H-1/2} \right]^2 du \\ &= (t - s)^{2H} \int_{\mathbb{R}} \left[(u + 1)_+^{H-1/2} - (u)_+^{H-1/2} \right]^2 du = C(t - s)^{2H}. \end{aligned}$$

Drugu jednakost dobivamo supstitucijom $u \leftarrow \frac{s-u}{t-s}$ nakon čega $(t-s)^{2H}$ izlazi van. Preostaje samo konstatirati da je integral koji stoji iza C doista konačan. \square

Teorem 3.2.4. (Harmonizabilna reprezentacija FBM). Neka je $H \in \langle 0, 1 \rangle$ i

$$K_t(u) = |u|^{-H-1/2} \cdot \begin{cases} \sin tu, & u \geq 0, \\ 1 - \cos tu, & u < 0. \end{cases}$$

Tada je $\{X_t\}$, definiran s $X_t = I(K_t)$, FBM s parametrom H .

Dokaz. Počnemo kao u prošlom dokazu:

$$\begin{aligned} \mathbb{E} \left[(X_t - X_s)^2 \right] &= \int_0^\infty \frac{(\sin tu - \sin su)^2}{u^{2H+1}} du + \int_{-\infty}^0 \frac{(\cos tu - \cos su)^2}{(-u)^{2H+1}} du \\ &= \int_0^\infty \frac{2 - 2 \cos(t-s)u}{u^{2H+1}} du \\ &= (t-s)^{2H} \int_0^\infty \frac{1 - \cos u}{u^{2H+1}} du = C(t-s)^{2H}. \end{aligned}$$

Pritom, druga jednakost dobiva se supstitucijom $u \leftarrow -u$ u drugom integralu da se svedu na jedan, zatim se dovršava s $u \leftarrow (t-s)u$. Očito je C opet konačan. \square

Komentar 3.2.5. Bla bla

² $a_+ = \max \{0, a\}$

Bibliografija

- [AFT00] Patrice Abry, Patrick Flandrin i M. Taqqu. „Self-Similarity and Long-Range Dependence Through the Wavelet Lens”. (Svibanj 2000.).
- [Aya10] Antoine Ayache. „A mini-course on Wavelets and Fractional Processes”. (2010.). URL: https://pro.univ-lille.fr/fileadmin/user_upload/pages_pros/antoine_ayache/COURSE-WavFrac.pdf.
- [Dau92] Ingrid Daubechies. *Ten lectures on wavelets*. CBMS-NSF Regional conference series in applied mathematics 61. Society for Industrial i Applied Mathematics (SIAM), 1992.
- [Die16] Antoine Diez. „Lévy’s construction of Brownian motion”. (2016.). URL: <https://perso.eleves.ens-rennes.fr/people/Antoine.Diez/brownienlevy.pdf>.
- [EM02] Paul Embrechts i Makoto Maejima. *Selfsimilar processes*. Princeton series in applied mathematics. Princeton University Press, 2002.
- [Sar80] Nikola Sarapa. *Teorija vjerojatnosti*. Udžbenici Sveučilišta u Zagrebu. Školska Knjiga, 1980.
- [Sat99] Ken-iti Sato. *Lévy processes and infinitely divisible distributions*. Cambridge studies in advanced mathematics 68. Cambridge Univ. Press, 1999.
- [Šev15] Heorhij Ševčenko. „Fractional Brownian motion in a nutshell”. (Siječanj 2015.). URL: <https://arxiv.org/abs/1406.1956>.

Sažetak

U ovom radu...

Summary

In this thesis...

Životopis

Luka Šimek rođen je 2000. u Zagrebu gdje završava XV. gimnaziju 2019. Tijekom školovanja ističe se na natjecanjima, prvenstveno drugim mjestom na državnom natjecanju iz matematike (2016., Primošten) i brončanom medaljom na individualnom dijelu Srednjoeuropske matematičke olimpijade (2017., Vilnius).

Preddiplomski studij matematike na zagrebačkom PMF-u upisuje 2019. Završetkom preddiplomskog studija 2022. upisuje diplomski studij Matematičke statistike. Tijekom preddiplomskog studija radi kao demonstrator iz kolegija Matematička analiza (1 i 2) i Programiranje (1 i 2).