Rachunek prawdopodobieństwa 2R

Kycia

Spis rozmaitości treściowalnych

Wykład 06.10.23 : Warunkowa wartość oczekiwana

1.1 Prawdopodobieństwo warunkowe

Tak jak zwykle do tej pory, pracować będziemy na przestrzeni probabilistycznej $(\Omega, \mathcal{F}, \mathbb{P})$.

Przypomnijmy definicję **prawdopodobieństwa warunkowego** z Rachunku Prawdopodobieństwa 1 (i z liceum). Dla zdarzenia $A \in \mathcal{F}$ takiego, że $\mathbb{P}[A] \in (0,1)$ definiujemy prawdopodobieństwo warunkowe jako

$$\mathbb{P}\left[B \mid A\right] = \frac{\mathbb{P}[A \cap B]}{\mathbb{P}[A]}.$$

Wartość ta informuje nas o zajściu B wtedy, gdy jesteśmy pewni, że A zaszło. Ale co, jeśli nasza wiedza dotycząca A jest mniej pewna? To znaczy, *co jeśli* $\mathbb{P}[A] = 0$? Dość naturalne wydaje się rozważenie zdarzenia przeciwnego i zsumowania obu prawdopodobieństw:

$$\mathbb{1}_A \mathbb{P}\left[B \mid A\right] + \mathbb{1}_{A^c} \mathbb{P}\left[B \mid A^c\right].$$

Zauważmy od razu, że wyrażenie $\mathbb{1}_A \mathbb{P}\left[B \mid A\right]$ jest zmienną losową.

W przypadku, gdy mamy dwa zbiory, $A_1, A_2 \in \mathcal{F}$, i chcemy zbadać $\mathbb{P}\left[B \mid A_1 \cap A_2\right]$ możemy powyższe rozumowanie rozszerzyć na wszystkie możliwe kombinacje A_1, A_2 i ich dopełnień:

$$\mathbb{1}_{A_1 \cap A_2} \mathbb{P}\left[B \mid A_1 \cap A_2\right] + \mathbb{1}_{A_1 \cap A_2^c} \mathbb{P}\left[B \mid A_1 \cap A_2^c\right] + \mathbb{1}_{A_1^c \cap A_2} \mathbb{P}\left[B \mid A_1^c \cap A_2\right] + \mathbb{1}_{A_1^c \cap A_2^c} \mathbb{P}\left[B \mid A_1^c \cap A_2^c\right].$$

Działanie jak wyżej daje pełną informacje o każdym zdarzeniu z ciała generowanego przez zdarzenia A_1 i A_2. Nazywamy je **rozbiciem** względem σ-ciała generowanego przez A_1 i A_2.

Analogicznie możemy zdefiniować $\mathbb{E}\left[X \mid A\right]$ dla całkowalnej zmiennej losowej X (tzn. $\mathbb{E}\left[|X|\right] < \infty$):

$$\mathbb{E}\left[X \mid A\right] = \int_\Omega X(\omega) \mathbb{P}\left[d\omega \mid A\right] = \frac{1}{\mathbb{P}[A]} \mathbb{E}[X \mathbb{1}_A],$$

gdzie całka wyżej tłumaczy się na całkę po X względem miary $\mathbb{P}\left[B \mid A\right]$.

Uzasadnimy, dlaczego wzór wyżej jest zasadną definicją prawdopodobieństwa warunkowego przy ograniczonej wiedzy o zdarzeniu A.

1.2 Konstrukcja warunkowej wartości oczekiwanej

Zanim zdefiniujemy **warunkową wartość oczekiwaną [wwo]** zmiennej losowej X, zaczniemy od przyjrzenia się bliżej motywacji i konstrukcji stojącej za tym pojęciem.

Niech Z będzie całkowalną zmienną losową przyjmującą przeliczalnie wiele wartości. Zdefiniujmy funkcję

$$h(z) = \begin{cases} \mathbb{E}\left[X \mid Z = z\right] & \mathbb{P}[Z = z] > 0 \\ 0 & \text{wpp} \end{cases}$$

oraz zmienną losową $Y = h(Z)$. Weźmy dowolny $C \in Bor(\mathbb{R})$ i zbadajmy $\mathbb{E}\left[Y \mathbb{1}_{\{Z \in C\}}\right]$. Zaczniemy od skorzystania z faktu, że Z przyjmuje przeliczalnie wiele wartości, więc możemy zapisać sumę po nich wszystkich

$$\begin{aligned}\mathbb{E}\left[Y\mathbb{1}_{\{Z\in C\}}\right] &= \sum_{z\in C} h(z)\mathbb{P}[Z=z] = \\ &\stackrel{\star}{=} \sum_{z\in C}\mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_{\{Z=z\}}\right]\frac{1}{\mathbb{P}[Z=z]}\mathbb{P}[Z=z] = \\ &= \sum_{z\in C}\mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_{\{Z=z\}}\right] = \\ &= \mathbb{E}\left[\sum_{z\in C} X\mathbb{1}_{\{Z=z\}}\right] = \\ &= \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_{\{Z\in C\}}\right]\end{aligned}$$

Równość $\star$ wynika ze sposobu w jaki zdefiniowaliśmy $\mathbb{E}\left[X \mid A\right]$ w poprzednim podrozdziale.

Zauważmy, że dowolne zdarzenie $F \in \sigma(Z)$ jest postaci $F = \{z \in C\}$ dla pewnego $C \in \mathrm{Bor}(\mathbb{R})$. Wyprowadziliśmy więc równość:

$$\mathbb{E}[Y\mathbb{1}_F] = \mathbb{E}[X\mathbb{1}_F] \qquad F \in \sigma(Z).$$

Pozostaje zapytać, co z tej zależności wynika?

Dla $F = \Omega$ dostajemy

$$\mathbb{E}\left[h(Z)\right] = \mathbb{E}[Y] = \mathbb{E}[X].$$

> **Dygresja.**
> W tym miejscu kuszące byłoby rozpisanie $Y = h(Z)$ wprost z definicji, tzn. $h(Z) = \mathbb{E}\left[X \mid Z = Z\right]$, ale jest to całkowitą brednią. W definicji funkcji h podanej na samym początku przykładu z jest teoretycznym punkcikiem, natomiast przy definiowaniu $Y = h(Z)$ ów Z jest już obserwowaną przez nas, konkretną zmienną losową. W takim razie, bardziej poprawny byłby zapis
>
> $$h(Z(\omega)) = \mathbb{E}\left[X \mid \{\omega' : Z(\omega') = Z(\omega)\}\right].$$

Przykład(y) 1.1

1. Ze zbioru $\{1, 2, ..., 10\}$ losujemy w sposób jednostajny liczbę i oznaczamy ją jako N. W drugim losowaniu, również w sposób jednostajny, wybieramy liczbę ze zbioru $\{1, ..., N\}$ i nazywamy ją M. Chcemy znaleźć średnią wartość liczby M. Oczywiście, nie jest trudno zrobić to metodami poznanymi na poprzednich przygodach probabilistycznych, jednak w tym przypadku użyjemy konstrukcji wyżej.

   Funkcja h będzie wyglądać następująco:

   $$h(n) = \mathbb{E}\left[M \mid N = n\right] = \sum_{1\le i\le n}\frac{i}{n} = \frac{1}{n}\cdot\frac{n(n+1)}{2} = \frac{n+1}{2}$$

   czyli $h(N) = \frac{N+1}{2}$.

   Stosując notację jak wyżej, mamy

   $$\begin{aligned}Z &= N\\ X &= M\end{aligned}$$

czyli podstawiając do wzoru:

$$\begin{aligned}
\mathbb{E}\left[M\right] = \mathbb{E}\left[h(N)\right] = \mathbb{E}\left[\frac{N+1}{2}\right] = \\
= \frac{1}{2}\left(\mathbb{E}\left[N\right]+1\right) = \frac{1}{2}\left(\sum_{1\leq i\leq 10}\frac{i}{10}+1\right) = \\
= \frac{1}{2}\left(\frac{11}{2}+1\right)\frac{13}{4}
\end{aligned}$$

Rozbicie jak wyżej można w elegancki sposób zamienić w bardziej abstrakcyjną definicję warunkowej wartości oczekiwanej.

Definicja 1.1.

Niech $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ będzie σ-ciałem, a X całkowalną zmienną losową.

Zmienną losową Y nazywamy **warunkową wartością oczekiwaną** [wwo] X pod warunkiem $\mathcal{G}$, jeśli następujące warunki są spełnione:

(W1) Y jest $\mathcal{G}$-mierzalne

(W2) $(\forall\ G \in \mathcal{G})\ \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_G\right] = \mathbb{E}\left[Y\mathbb{1}_G\right]$

Nasuwają się teraz pytania o poprawność Y zdefiniowanego jak wyżej. Czy zawsze istnieje i czy jest on jedyny?

Przykład(y) 1.2

1. Niech $\mathcal{G} = \sigma(Z)$, gdzie Z jest zmienną losową przyjmującą przeliczalnie wiele wartości. Wówczas $Y = h(Z)$ dla $h(z) = \mathbb{E}\left[X \mid Z = z\right]$ jest wwo X względem $\mathcal{G}$.

Twierdzenie 1.1 : poprawność wwo.

Dla σ-ciała $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ i całkowalnej zmiennej losowej X **istnieje jedyna zmienna losowa** Y będąca wwo X względem $\mathcal{G}$. Będziemy ją oznaczać

$$\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] = Y.$$

Jeśli Y, Y' są wwo X względem $\mathcal{G}$, to $Y = Y'$ prawie wszędzie.

Dowód

Dowód na następnym wykładzie.

Uwaga 1.2.

O wwo X pod warunkiem $\mathcal{G}$ należy myśleć jako o przybliżeniu X na podstawie informacji zawartych w $\mathcal{G}$ (więcej na wykładzie 3).

Przykład(y) 1.3

1. Jeśli X i $\mathcal{G}$ są niezależne, to znaczy dla każdego $B \in \mathrm{Bor}(\mathbb{R})$ i dla każdego $G \in \mathcal{G}$ zachodzi

$$\mathbb{P}[X \in B, G] = \mathbb{P}[X \in B]\,\mathbb{P}[G],$$

   to wtedy $\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}[X] = Y$.

   Warunek (W1) jest oczywiście spełniony, bo Y jest funkcją stałą, więc jego przeciwobraz to całość lub $\emptyset$ (czyli jest $\mathcal{G}$-mierzalny). Warunek (W2) sprawdzamy dla dowolnego $G \in \mathcal{G}$:

$$\mathbb{E}[X\mathbb{1}_G] = \mathbb{E}[X]\,\mathbb{E}[\mathbb{1}_G] = \mathbb{E}[\mathbb{E}[X]\,\mathbb{1}_G] = \mathbb{E}[Y\mathbb{1}_G].$$

2. Rozważmy pokrycie Ω rozłącznymi zbiorami $\{A_n\}_{n\in\mathbb{N}}$, gdzie $A_i \in \mathcal{F}$ dla każdego i. Niech $\mathcal{G} = \sigma(A_i : i \in \mathbb{N})$ będzie σ-ciałem rozpinanym przez to pokrycie. Wówczas

$$\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] = \sum_{i\in\mathbb{N}} \mathbb{1}_{A_i}\mathbb{E}\left[X \mid A_i\right]$$

   Spełnianie pierwszego warunku jest oczywiste, bo mamy doczynienia z funkcją prostą. Warunek (W2) wystarczy sprawdzić dla atomów, czyli $G = A_i$, bo wszystkie zmienne losowe $\mathcal{G}$-mierzalne są stałe na A_i.

$$\begin{aligned}\mathbb{E}\left[\left[\sum \mathbb{1}_{A_i}\mathbb{E}\left[X \mid A_i\right]\right]\mathbb{1}_{A_j}\right] &= \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid A_j\right]\mathbb{1}_{A_j}\right] = \\ &= \mathbb{E}\left[\mathbb{1}_{A_j}\frac{\mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_{A_j}\right]}{\mathbb{P}\left[A_j\right]}\right] = \\ &= \mathbb{E}\left[\mathbb{1}_{A_j}\right]\frac{\mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_{A_j}\right]}{\mathbb{P}\left[A_j\right]} = \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_{A_j}\right],\end{aligned}$$

   gdyż $\mathbb{E}\left[\mathbb{1}_{A_j}\right] = \mathbb{P}\left[A_j\right]$.

3. Jeśli w przykładzie wyżej weźmiemy $A_1 = A$, $A_2 = A^c$ i $A_3 = A_4 = \ldots = \emptyset$ oraz $\mathcal{G} = \sigma(A)$, to dostajemy to samo co na samym początku tego wykładu:

$$\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] - \mathbb{1}_A\mathbb{E}\left[X \mid A\right] + \mathbb{1}_{A^c}\mathbb{E}\left[X \mid A^c\right].$$

1.3 Prawdopodobieństwo warunkowe

Definicja 1.2 : prawdopodobieństwo warunkowe.
Dla σ-ciała $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ definiujemy **prawdopodobieństwo warunkowe** pod warunkiem $\mathcal{G}$ jako

$$\mathbb{P}\left[A \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}\left[\mathbb{1}_A \mid \mathcal{G}\right]$$

Prawdopodobieństwo $\mathbb{P}\left[A \mid \mathcal{G}\right]$ jest zmienną losową taką, że:

- $\mathbb{P}\left[A \mid \mathcal{G}\right]$ jest $\mathcal{G}$-mierzalna (ze względu na wwo w definicji)
- $\mathbb{E}\left[\mathbb{P}\left[A \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_G\right] = \mathbb{E}[\mathbb{1}_A\mathbb{1}_G] = \mathbb{P}[A \cap G]$

Przykład(y) 1.4

1. Niech E_1, E_2 będą niezależnymi zmiennymi losowymi z rozkładem $\exp(1)$. Chcemy się zastanowić jak wygląda prawdopodobieństwo

$$\mathbb{P}\left[E_1 + E_2 > t \mid \sigma(E_1)\right]$$

dla $t > 0$. Ponieważ liczymy to prawdopodobieństwo względem $\sigma(E_1)$, to tak naprawdę wszystkie informacje o E_1 mamy w ręku, gdyż tę zmienną obserwujemy. Czyli E_1 możemy w takim przypadku potraktować jako zwykłą stałą i zgadnąć, że

$$\mathbb{P}\left[E_1 + E_2 > t \mid \sigma(E_1)\right] = e^{-(t-E_1)}.$$

Dla pewności, przerachujemy cały ten przykład wprost z definicji, żeby przekonać się że strzał był poprawny.

Niech $G \in \sigma(E_1)$, wtedy zgodnie z wcześniejszą obserwacją istnieje pewne $C \in \mathrm{Bor}(\mathbb{R})$ takie, że G jest postaci $G = \{E_1 \in C\}$. Policzymy $\mathbb{E}\left[\mathbb{P}\left[\{E_1 + E_2 > t\} \mid \sigma(E_1)\right]\right]$ gdyż jak wyżej zauważyliśmy, $\mathbb{P}\left[A \mid \mathcal{G}\right]$ jest zmienną losową. Mamy więc

$$\begin{aligned}
\mathbb{E}\left[\mathbb{P}\left[E_1 + E_2 > t \mid \sigma(E_1)\right] \mathbb{1}_G\right] &\overset{\star}{=} \mathbb{P}\left[\{E_1 + E_2 > t\} \cap G\right] = \\
&= \mathbb{P}\left[\{E_1 + E_2 > t\} \cap \{E_1 \in C\}\right] = \\
&= \iint\limits_{\substack{C \times \mathbb{R}_+ \\ x+y>t}} e^{-x} e^{-y} dxdy = \\
&= \int_C e^{-x} \underbrace{\left[\int_{x+y>t} e^{-y} dy\right]}_{\star\star} dx = \\
&= \int_C e^{-x} e^{-(t-x)_+} dx = \mathbb{E}\left[e^{-(t-E_1)_+} \mathbb{1}_{\{E_1 \in C\}}\right] = \mathbb{E}\left[e^{-(t-E_1)_+} \mathbb{1}_G\right]
\end{aligned}$$

Równość $\star$ wynika z uwagi pod definicją prawdopodobieństwa warunkowego. Całka $\star\star$ jest równa 1 gdy $x > t$ (gdyż wtedy dla każdego y mamy $x + y > t$), natomiast dla $x \leq t$ wynosi ona $e^{-(t-x)}$.

Wykład 09.10.23 : Własności WWO

Na tym wykładzie zajmiemy się dowodzeniem własności wwo, w tym pokażemy jej istnienie i jedyność.

2.1 Istnienie i jedyność

Lemat 2.1 : WWO jest całkowalna.
To znaczy, że mając całkowalną zmienną losową X oraz σ-ciało $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$, to zachodzi $\mathbb{E}\left[\left|\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\right|\right] < \infty$.

Dowód
Rozważmy zbiór

$$A = \{\omega \ : \ \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right](\omega) > 0\} = \{\omega \ : \ \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \in (0, \infty)\} = \left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\right]^{-1}((0, \infty))$$

jako przeciwobraz zbioru $(0, \infty) \in \mathrm{Bor}(\mathbb{R})$ przez funkcję $\mathcal{G}$-mierzalną $\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$ wiemy, że $A \in \mathcal{G}$. Ponieważ $\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$ jest wwo X pod warunkiem $\mathcal{G}$, to musi warunek (W2):

$$0 \leq \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_A\right] \leq \mathbb{E}\left[|X|\mathbb{1}_A\right] < \infty$$

bo X jest całkowalna.

Analogicznie postępujemy dla zbioru A^c:

$$0 \leq \mathbb{E}\left[-\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[-X\mathbb{1}_{A^c}\right] \leq \mathbb{E}\left[|X|\mathbb{1}_{A^c}\right] < \infty.$$

Zauważmy, że

$$\left|\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\right| = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \mathbb{1}_A - \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \mathbb{1}_{A^c}$$

Dodając obie te nierówności (i korzystając z liniowości wartości oczekiwanej) uzyskujemy

$$0 \leq \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \mathbb{1}_A\right] - \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \mathbb{1}_{A^c}\right] = \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \mathbb{1}_A - \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \mathbb{1}_{A^c}\right] = \mathbb{E}\left[\left|\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\right|\right] < \infty$$

Lemat 2.2 : jedyność p.w..
Niech $\mathcal{G} \subseteq F$ będzie σ-ciałem. Jeśli Y i Y′ są obie wersjami $\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$, to $Y = Y'$ p.w..

Dowód
Ustalmy $\varepsilon > 0$ i rozważmy zdarzenie

$$A_\varepsilon = \{Y - Y' > \varepsilon\} \in \mathcal{G}$$

które jest $\mathcal{G}$-mierzalne, bo Y i Y′ takie są.

$$\begin{aligned} \varepsilon\mathbb{P}\left[A_\varepsilon\right] + \mathbb{E}\left[Y'\mathbb{1}_{A_\varepsilon}\right] &= \mathbb{E}\left[\varepsilon\mathbb{1}_{A_\varepsilon}\right] + \mathbb{E}\left[Y'\mathbb{1}_{A_\varepsilon}\right] = \\ &= \mathbb{E}\left[(\varepsilon + Y')\mathbb{1}_{A_\varepsilon}\right] \leq \\ &\overset{\star}{\leq} \mathbb{E}\left[Y\mathbb{1}_{A_\varepsilon}\right] \overset{(W2)}{=} \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_{A_\varepsilon}\right] = \\ &= \mathbb{E}\left[Y'\mathbb{1}_{A_\varepsilon}\right] \end{aligned}$$

gdzie $\star$ wynika z tego, że na zbiorze A_ε $Y > Y' + \varepsilon$.

Dostajemy więc, że

$$\varepsilon\mathbb{P}\left[A_\varepsilon\right] + \mathbb{E}\left[Y'\mathbb{1}_{A_\varepsilon}\right] \leq \mathbb{E}\left[Y'\mathbb{1}_{A_\varepsilon}\right]$$

co po przeniesieniu $\mathbb{E}$ na jedną stronę daje

$$\varepsilon\mathbb{P}\left[A_\varepsilon\right] \leq 0$$

a ponieważ $\varepsilon > 0$, to musi być $\mathbb{P}\left[A_\varepsilon\right] = 0$.

Wówczas

$$\mathbb{P}\left[Y > Y'\right] = \underbrace{\mathbb{P}\left[(\exists\ n)\ Y \geq Y' + \frac{1}{n}\right]}_{\mathbb{P}\left[A_{\frac{1}{n}}\right]} = \mathbb{P}\left[\bigcup A_{\frac{1}{n}}\right] = \lim \mathbb{P}\left[A_{\frac{1}{n}}\right] = 0$$

ponieważ $A_{\frac{1}{n}} \subseteq A_{\frac{1}{n+1}}$.

Zamieniając miejscami Y i Y' w dowodzie dostaniemy $\mathbb{P}\left[Y' > Y\right] = 0$, czyli obie możliwości są miary zero.

Twierdzenie 2.3 : o istnieniu WWO.

Niech $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ będzie σ-ciałem, a X jest całkowalną zmienną losową. Istnieje zmienna losowa Y spełniająca oba postulaty wwo X pod warunkiem $\mathcal{G}$.

Jest to Twierdzenie 1.1 z poprzedniego wykładu.

Zanim jednak przejdziemy do dowodu 2.3, przypomnijmy *twierdzenie Radona-Nikodyma* z teorii miary:

Dygresja : twierdzenie Radona-Nikodyma.

Niech μ i ν będą σ-miarami na przestrzeni $(\Omega, \mathcal{G})$ takimi, że ν jest *absolutnie ciągła* względem μ $[\nu \ll \mu]$, tzn $\mu(A) = 0 \Rightarrow \nu(A) = 0$. Wówczas istnieje $\mathcal{G}$-mierzalna funkcja $f : \Omega \to \mathbb{R}$ taka, że

$$\nu(A) = \int_A f(x)\mu(dx)$$

Funkcję f jak wyżej często oznaczamy $f = \frac{d\nu}{d\mu}$ i nazywamy *pochodną Radona-Nikodyma*.

Dowód

Wracając do dowodu twierdzenia 2.3. Najpierw pokażemy prostszy przykład, gdy $X \geq 0$, a potem uogólnimy go do dowolnego X.

Załóżmy, że $X \geq 0$ p.w. Wtedy możemy rozważyć miary $\mu = \mathbb{P} \restriction \mathcal{G}$ oraz $\nu(A) = \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_A\right]$. Od razu widać, że w takim ułożeniu $\nu \ll \mu$, więc na mocy twierdzenia Radona-Nikodyma istnieje f $\mathcal{G}$-mierzalna taka, że

$$\mathbb{E}\left[f\mathbb{1}_A\right] = \int_A f(\omega)\mu(d\omega) = \nu(A) - \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_A\right].$$

Funkcja f spełnia (W1) z definicji wwo, bo jest $\mathcal{G}$-mierzalna, a (W2) jest potwierdzone przez rachunek wyżej. Czyli f jest wwo X pod warunkiem $\mathcal{G}$.

Niech teraz X będzie dowolną zmienną losową. Możemy ją rozbić jako

$$X = X^+ - X^-,$$

gdzie $X^+ = \max(0, X) \geq 0$ oraz $X^- = -\min(0, X) \geq 0$. Do obu tych zmiennych możemy zastosować pierwszą część dowodu, by dostać zmienne $\mathbb{E}\left[X^+ \mid \mathcal{G}\right]$ oraz $\mathbb{E}\left[X^- \mid \mathcal{G}\right]$. Wystarczy zauważyć, że dzięki liniowości $\mathbb{E}$ możemy w prosty sposób pokazać

$$\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}\left[X^+ \mid \mathcal{G}\right] - \mathbb{E}\left[X^- \mid \mathcal{G}\right]$$

2.2 Własności wwo

Twierdzenie 2.4 : o arytmetyce wwo.
Niech $\mathcal{G}, \mathcal{G}_1, \mathcal{G}_2 \subseteq \mathcal{F}$ będą σ-ciałami, a X, X_1, X_2 całkowalnymi zmiennymi losowymi

1. $\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\right] = \mathbb{E}\left[X\right]$
2. Jeśli $X \geq 0$, to również $\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \geq 0$
3. $\mathbb{E}\left[aX_1 + bX_2 \mid \mathcal{G}\right] = a\mathbb{E}\left[X_1 \mid \mathcal{G}\right] + b\mathbb{E}\left[X_2 \mid \mathcal{G}\right]$
4. $\left|\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\right| \leq \mathbb{E}\left[|X| \mid \mathcal{G}\right]$
5. Jeśli $\mathcal{G}_1 \subseteq \mathcal{G}_2$, to wówczas

   $$\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_1\right] \mid \mathcal{G}_2\right] = \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_2\right] \mid \mathcal{G}_1\right] = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_1\right]$$

   To znaczy, że mając informacje o X w dwóch zawartych w sobie ciałach, to mniejsze zawsze wygrywa.
6. Jeśli Y jest $\mathcal{G}$-mierzalna i XY jest całkowalna, to $\mathbb{E}\left[XY \mid \mathcal{G}\right] = Y\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$, czyli Y możemy traktować jako stałą.

Dowód

1. Wystarczy wstawić $G = \Omega$ w warunek (W2):

   $$\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\right] = \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \mathbb{1}_\Omega\right] \overset{(W2)}{=} \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_\Omega\right] = \mathbb{E}\left[X\right]$$

2. Wynika z dowodu twierdzenia o istnieniu, bo $\frac{d\nu}{d\mu} = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$. Gdyby $A = \{\omega : \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] < 0\}$, to wówczas

   $$\mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_A\right] = \nu(A) = \int_A \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right](\omega)\mu(d\omega) = \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_A\right] < 0$$

   ale przecież $X \geq 0 \Rightarrow \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_A\right] \geq 0$, więc $A = \emptyset$.
3. Można to zrobić na dwa sposoby: licząc wszystko pokolei, albo można sprawdzić, czy $Y = a\mathbb{E}\left[X_1 \mid \mathcal{G}\right] + b\mathbb{E}\left[X_2 \mid \mathcal{G}\right]$ spełnia warunki wwo tej samej zmiennej co $\mathbb{E}\left[aX_1 + bX_2 \mid \mathcal{G}\right]$. Wówczas obie te zmienne są równe prawie wszędzie.

Warunek $\mathcal{G}$-mierzalności dla Y jest spełniony, bo Y jest kombinacją liniową dwóch funkcji $\mathcal{G}$-mierzalnych. Wystarczy więc sprawdzić warunek (W2). W tym celu ustalmy $A \in \mathcal{G}$.

$$\begin{aligned}\mathbb{E}\left[Y\mathbb{1}_A\right] &\overset{\star}{=} a\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X_1 \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_A\right] + b\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X_2 \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_A\right] = \\ &= a\mathbb{E}\left[X_1\mathbb{1}_A\right] + b\mathbb{E}\left[X_2\mathbb{1}_A\right] = \\ &= \mathbb{E}\left[(aX_1 + bX_2)\mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[aX_1 + bX_2 \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_A\right]\end{aligned}$$

4. Wiemy, że $-|X| \leq X \leq |X|$. Korzystając z punktu 2 dostajemy

$$0 \leq X + |X| \Rightarrow 0 \leq \mathbb{E}\left[|X| \mid \mathcal{G}\right] + \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \Rightarrow -\mathbb{E}\left[|X| \mid \mathcal{G}\right] \leq \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$$

$$0 \leq |X| - X \Rightarrow 0 \leq \mathbb{E}\left[|X| \mid \mathcal{G}\right] - \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \Rightarrow \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \leq \mathbb{E}\left[|X| \mid \mathcal{G}\right]$$

   Po złożeniu tych dwóch nierówności:

$$-\mathbb{E}\left[|X| \mid \mathcal{G}\right] \leq \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \leq \mathbb{E}\left[|X| \mid \mathcal{G}\right]$$

   wiemy, że $-|\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]| \leq \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] \leq |\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]|$, więc musi być

$$|\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]| \leq \mathbb{E}\left[|X| \mid \mathcal{G}\right].$$

5. Zaczniemy od sprawdzenia, że $\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_2\right] \mid \mathcal{G}_1\right] = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_1\right]$. Wybierzmy $A \in \mathcal{G}_1 \subseteq \mathcal{G}_2$:

$$\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_1\right]\mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_2\right]\mathbb{1}_A\right]$$

   co potwierdza warunek (W2). $\mathcal{G}_1$-mierzalność $\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_2\right]$ jest oczywista, gdyż $\mathcal{G}_1 \subseteq \mathcal{G}_2$, $\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_2\right]$ jest $\mathcal{G}_2$-mierzalne, a po obcięciu do $\mathcal{G}_1$ dostajemy funkcję $\mathcal{G}_1$-mierzalną.

   Pozostaje nam sprawdzić czym jest $\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_1\right] \mid \mathcal{G}_2\right]$. Roboczo nazwiemy $Y = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_1\right]$. Jest to funkcja $\mathcal{G}_1$-mierzalna, ale dzięki $\mathcal{G}_1 \subseteq \mathcal{G}_2$ mamy też $\mathcal{G}_2$-mierzalność. W takim razie (tak jak w jednym z przykładów z pierwszego wykładu) $\mathbb{E}\left[Y \mid \mathcal{G}_2\right] = Y$. Pisząc bez używania litery Y dostajemy

$$\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_1\right] \mid \mathcal{G}_2\right] = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}_1\right]$$

6. Ćwiczenie, a poniżej moja próba.

   Jeśli Y jest $\mathcal{G}$-mierzalne, to $Y\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$ też takie jest jako iloczyn dwóch funkcji $\mathcal{G}$-mierzalnych. Pozostaje sprawdzić warunek (W2).

   Zacznijmy od $Y = \sum a_i\mathbb{1}_{A_i}$ dla $A_i \in \mathcal{G}$, czyli od funkcji prostej. Wybierając $A \in \mathcal{G}$ możemy ograniczyć się do zbiorów A_i, gdyż są one rozłączne i na dowolnym innym zbiorze $Y = 0$. Mamy więc

$$\begin{aligned}\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[XY \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_{A_i}\right] &\overset{(W2)}{=} \mathbb{E}\left[XY\mathbb{1}_{A_i}\right] = \mathbb{E}\left[a_iX\mathbb{1}_{A_i}\right] = a_i\mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_{A_i}\right] = \\ &= a_i\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_{A_i}\right] = \mathbb{E}\left[(a_i\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right])\mathbb{1}_{A_i}\right] = \\ &= \mathbb{E}\left[(Y\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right])\mathbb{1}_{A_i}\right]\end{aligned}$$

   Czyli $\mathbb{E}\left[XY \mid \mathcal{G}\right] = Y\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$ dla przypadku gdy Y jest funkcją prostą.

   Jeśli teraz Y jest dowolną nieujemną funkcją mierzalną, to istnieje ciąg funkcji prostych

$$s_1 \leq s_2 \leq \ldots \leq s_n \leq \ldots \qquad \lim s_i = Y$$

Wówczas dla dowolnego $A \in \mathcal{G}$

$$\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[XY\right]\mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[XY\mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[X\lim s_i\mathbb{1}_A\right] \overset{\star}{=} \lim\mathbb{E}\left[Xs_i\mathbb{1}_A\right] =$$
$$\overset{\star\star}{=} \lim\mathbb{E}\left[s_i\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[\lim s_i\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_A\right] =$$
$$= \mathbb{E}\left[Y\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_A\right]$$

$\star$ można zrobić na mocy twierdzenia o monotoniczności ciągu s_i dla zwykłej $\mathbb{E}$, natomiast $\star\star$ stosuje poprzedni przypadek Y.

Pozostaje przypadek, gdy Y jest dowolną $\mathcal{G}$-mierzalną zmienną losową. Wówczas możemy rozbić $Y = Y^+ - Y^-$ i skorzystać z liniowości wwo:

$$\mathbb{E}\left[XY \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}\left[XY^+ \mid \mathcal{G}\right] - \mathbb{E}\left[XY^- \mid \mathcal{G}\right] = Y^+\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] - Y^-\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] = Y\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$$

Twierdzenie 2.5 : o zbieżności i ciągłości.
Niech $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ będzie σ-ciałem, a $X, X_1, X_2, \ldots$ będzie ciągiem całkowalnych zmiennych losowych. Wówczas

1. Jeśli $0 \leq X_1 \leq X_2 \leq \ldots$ oraz $X_n \nearrow X$, to $\mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right] \nearrow \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$ p.w. (twierdzenie o zbieżności monotonicznej)
2. Jeśli $X \geq 0$, to $\mathbb{E}\left[\liminf_n X_n \mid \mathcal{G}\right] \leq \liminf_n \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$ (lemat Fatou).
3. Jeśli $|X_n| \leq Y$ oraz Y jest całkowalny i $X_n \to X$ p.w., to $\mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right] \to \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$ (twierdzenie o zbieżności ograniczonej)

Dowód

1. Zauważamy, że ciąg $\mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$ jest niemalejący i ograniczony przez $\mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$ (na mocy punktu 2 z poprzedniego twierdzenia).

   Niech $Y = \lim\mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$. Wystarczy, że pokażemy $Y = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$ p.w., czyli sprawdzimy warunki (W1) i (W2). Oczywiście, warunek (W1) wynika z faktu, że granica ciągu funkcji $\mathcal{G}$-mierzalnych jest nadal $\mathcal{G}$-mierzalna. Dla sprawdzenia warunku (W2) wybierzmy $A \in \mathcal{G}$

$$\mathbb{E}\left[Y\mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[\lim\mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_A\right] \overset{\star}{=} \lim\mathbb{E}\left[\mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]\mathbb{1}_A\right] =$$
$$= \lim\mathbb{E}\left[X_n\mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[\lim X_n\mathbb{1}_A\right] = \mathbb{E}\left[X\mathbb{1}_A\right]$$

   czyli $Y = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right]$ p.w.

2. Zaczniemy od dwóch obserwacji:

   Dla ciągu $\{a_n\}$ $\liminf a_n$ to najmniejszy z jego punktów skupienia, równoważnie:

$$\liminf_n a_n = \lim_{k\to\infty}\inf_{n\geq k} a_n$$

   Dla dowolnej przeliczalnej rodziny zmiennych losowych $\{Z_n\}_{n\in T}$ i dla dowolnego $t \in T$ mamy

$$\inf_{s\in T} Z_s \leq Z_t$$

$$\mathbb{E}\left[\inf_{s\in T} Z_s\right] \leq \mathbb{E}\left[Z_t\right]$$

$$\mathbb{E}\left[\inf_{s\in T} Z_s\right] \leq \inf_{t\in T} \mathbb{E}\left[Z_t\right]$$

(co jest tak naprawdę wersją lematu Fatou dla $\mathbb{E}$ z RP1R).

Stosując obserwację w przejściach $\star$, obserwację w przejsciu $\star\star$ oraz ptk 1. ($\inf_{n>k} X_n \leq \inf_{n>k+1} X_n$) w $\star\star\star$, dostajemy

$$\mathbb{E}\left[\liminf_n X_n \mid \mathcal{G}\right] \overset{\star}{=} \mathbb{E}\left[\lim_k \inf_{n>k} X_n \mid \mathcal{G}\right] \overset{\star\star\star}{=} \lim_k \mathbb{E}\left[\inf_{n>k} X_n \mid \mathcal{G}\right] \leq$$
$$\overset{\star\star}{\leq} \lim_k \inf_{n>k} \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right] \overset{\star}{=} \liminf_n \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$$

3. Rozważmy zmienne $X_n' = Y + X_n$. Ponieważ $|X_n| \leq Y$, to $Y + X_n \geq 0$.

$$\mathbb{E}\left[Y + \liminf X_n \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}\left[\liminf(X_n + Y) \mid \mathcal{G}\right] \overset{3.}{\leq} \liminf \mathbb{E}\left[Y + X_n \mid \mathcal{G}\right] =$$
$$= \mathbb{E}\left[Y\right] + \liminf \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$$

To daje nam, że $\mathbb{E}\left[\liminf X_n \mid \mathcal{G}\right] \leq \liminf \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$.

Postępując analogicznie dla $X_n" = Y - X_n$ (które dalej jest ≥ 0) dostaniemy $\mathbb{E}\left[\limsup X_n \mid \mathcal{G}\right] \geq \limsup \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$:

$$\mathbb{E}\left[Y - \limsup X_n \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}\left[\limsup(Y - X_n) \mid \mathcal{G}\right] =$$
$$= -\mathbb{E}\left[\liminf(X_n - Y) \mid \mathcal{G}\right] \overset{3.}{\geq} -\liminf \mathbb{E}\left[X_n - Y \mid \mathcal{G}\right] =$$
$$= \limsup \mathbb{E}\left[Y - X_n \mid \mathcal{G}\right]$$

Ale wiemy, że $\liminf X_n = X$ oraz $\limsup X_n = X$, czyli

$$\liminf \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right] \geq \mathbb{E}\left[\liminf X_n \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}\left[\limsup X_n \mid \mathcal{G}\right] \geq \limsup \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$$

ale przecież $\liminf \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right] \leq \limsup \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$, czyli musi być

$$\liminf \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right] = \limsup \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right]$$

i ponieważ lim inf = lim sup = lim to mamy

$$\lim \mathbb{E}\left[X_n \mid \mathcal{G}\right] = \mathbb{E}\left[X \mid \mathcal{G}\right].$$

Twierdzenie 2.6.
Niech $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ będzie σ-ciałem. Załóżmy, że

- X jest $\mathcal{G}$-mierzalna
- Y jest niezależna od $\mathcal{G}$
- funkcja $\psi : \mathbb{R}^2 \to \mathbb{R}$ jest mierzalna taka, że

$$\mathbb{E}\left[\psi(X, Y)\right] < \infty.$$

Wówczas

$$\mathbb{E}\left[\psi(X, Y) \mid \mathcal{G}\right] = \Psi(X),$$

gdzie funkcja $\Psi : \mathbb{R} \to \mathbb{R}$ jest zdefiniowana jako $\Psi(X) = \mathbb{E}\left[\psi(X, Y)\right]$.

Dowód

Jeśli $\psi(x, y) = xy$, to korzystając z punktu 3. twierdzenia 2.4 dostajemy

$$\psi(x) = \mathbb{E}[xY] = x\mathbb{E}[Y]$$