

Exercise 5.33 (Study of multidimensional Brownian motion) $B_t = (B_t^1, B_t^2, \dots, B_t^N)$ を $x = (x_1, \dots, x_N) \in \mathbb{R}^N$ スタートの N 次元 (\mathcal{F}_t) -BM とする. ここで N は 2 以上の整数とする.

1. $|B_t|^2$ は連続 semimartingale であり, $|B_t|^2$ の martingale part が true martingale であることを示せ.

証明. (途中) B_t^1, \dots, B_t^N は BM より連続 semimartingale なので, 伊藤の公式が適用できて, a.s. で任意の $t \geq 0$ に対し

$$\begin{aligned} |B_t|^2 &= |B_0|^2 + \sum_{i=1}^N \int_0^t \frac{\partial}{\partial x_i} |B_s|^2 dB_s^i + \frac{1}{2} \sum_{i,j=1}^N \int_0^t \frac{\partial^2}{\partial x_i \partial x_j} |B_s|^2 d\langle B^i, B^j \rangle_s \\ &= |x|^2 + \sum_{i=1}^N \int_0^t \frac{\partial}{\partial x_i} |B_s|^2 dB_s^i + \frac{1}{2} \sum_{i=1}^N \int_0^t \frac{\partial^2}{\partial x_i^2} |B_s|^2 ds \quad (i \neq j \implies \langle B^i, B^j \rangle = 0) \\ &= |x|^2 + \sum_{i=1}^N \int_0^t 2B_s^i dB_s^i + Nt. \end{aligned}$$

$$\because |B|^2 = (B^1)^2 + \dots + (B^N)^2 \text{ より } \frac{\partial}{\partial x_i} |B|^2 = 2B^i, \frac{\partial^2}{\partial x_i^2} |B|^2 = 2.$$

■

- 2.

$$\beta_t = \sum_{i=1}^N \int_0^t \frac{B_s^i}{|B_s|} dB_s^i$$

と定める (ただし $|B_s| = 0$ のとき $\frac{B_s^i}{|B_s|} = 0$ とする). β_t の定義に現れる確率積分の定義を正当化し, さらに $(\beta_t)_{t \geq 0}$ が 0 スタートの (\mathcal{F}_t) -BM であることを示せ.

証明. (途中)

■

- 3.

$$|B_t|^2 = |x|^2 + 2 \int_0^t |B_s| d\beta_s + Nt$$

が成り立つことを示せ.

証明. (途中)

■

4. 以降, $x \neq 0$ を仮定する. $\varepsilon \in (0, |x|)$, $T_\varepsilon = \inf \{t \geq 0 : |B_t| \leq \varepsilon\}$ とする. ここで任意の $a > 0$ に対し

$$f(a) = \begin{cases} \log a & (N = 2), \\ a^{2-N} & (N \geq 3) \end{cases}$$

と定める. $f(|B_{t \wedge T_\varepsilon}|)$ が CLM となることを示せ.

証明. (途中)

■

5. $R > |x|, S_R = \inf \{t \geq 0 : |B_t| \geq R\}$ とする.

$$P(T_\varepsilon < S_R) = \frac{f(R) - f(|x|)}{f(R) - f(\varepsilon)}$$

となることを示せ. また $\varepsilon \rightarrow 0$ としたとき $P(T_\varepsilon < S_R) \rightarrow 0$ となることを確かめ, a.s. で任意の $t \geq 0$ に対し $B_t \neq 0$ となることを示せ.

証明. (途中)

■

6. a.s. で任意の $t \geq 0$ に対し

$$|B_t| = |x| + \beta_t + \frac{N-1}{2} \int_0^t \frac{ds}{|B_s|}$$

となることを示せ.

証明. (途中)

■

7. $N \geq 3$ を仮定する. a.s. で $t \rightarrow \infty$ としたとき $|B_t| \rightarrow \infty$ となることを示せ (ヒント: $|B_t|^{2-N}$ が非負 supermartingale であることを確かめよ).

証明. (途中)

■

8. $N = 3$ を仮定する. Gaussian density の形式を用いて, r.v. の族 $(|B_t|^{-1})_{t \geq 0}$ が L^2 -bdd. であることを確かめよ. また $(|B_t|^{-1})_{t \geq 0}$ が CLM であり, かつ true martingale でないことを示せ.

証明. (途中)

■