

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

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

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

■

- 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) 任意の $1 \leq i \leq N$ に対し $\frac{B^i}{|B|} \leq 1$ より, a.s. で任意の $t \geq 0$ に対し

$$\int_0^t \left(\frac{B_s^i}{|B_s|} \right)^2 d\langle B^i, B^i \rangle_s \leq \int_0^t ds = t < \infty$$

が成り立つので, 任意の $1 \leq i \leq N$ に対し $\frac{B^i}{|B|} \in L_{\text{loc}}^2(B^i)$. よって Thm 5.6 より $\int_0^t \frac{B_s^i}{|B_s|} dB_s^i$ は確率積分の意味で well-defined な CLM である.

したがって β は (\mathcal{F}_t) -CLM である (←?). ここで

$$\begin{aligned} \langle \beta, \beta \rangle_t &= \left\langle \sum_{i=1}^N \int_0^\cdot \frac{B_s^i}{|B_s|} dB_s^i, \sum_{i=1}^N \int_0^\cdot \frac{B_s^i}{|B_s|} dB_s^i \right\rangle_t \\ &= \sum_{i=1}^N \left\langle \int_0^\cdot \frac{B_s^i}{|B_s|} dB_s^i, \int_0^\cdot \frac{B_s^i}{|B_s|} dB_s^i \right\rangle_t \\ &= \int_0^t \frac{\sum_{i=1}^N (B_s^i)^2}{|B_s|^2} ds = \int_0^t \frac{|B_s|^2}{|B_s|^2} ds = t \end{aligned}$$

が成り立つことより, β は 0 スタートの (\mathcal{F}_t) -BM である.

■

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.

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

より $d\beta_t = \sum_{i=1}^N \frac{B_t^i}{|B_t|} dB_t^i$ となるので

$$\begin{aligned} |B_t|^2 &= |x|^2 + 2 \sum_{i=1}^N \int_0^t B_s^i dB_s^i + Nt \\ &= |x|^2 + 2 \sum_{i=1}^N \int_0^t |B_s| \frac{B_s^i}{|B_s|} dB_s^i + Nt \\ &= |x|^2 + 2 \int_0^t |B_s| \sum_{i=1}^N \frac{B_s^i}{|B_s|} dB_s^i + Nt \\ &= |x|^2 + 2 \int_0^t |B_s| d\beta_s + Nt. \end{aligned}$$

■

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. $F(x) = |x|$ と定めると $F \in C^\infty(\mathbb{R}^N \setminus \{0\})$ であり, $\frac{\partial F}{\partial x_i}(x) = \frac{x_i}{|x|}$, $\frac{\partial^2 F}{\partial x_i^2}(x) = \frac{|x|^2 - x_i^2}{|x|^3}$. a.s. で任意の $t \geq 0$ に対し $B_t \in \mathbb{R}^N \setminus \{0\}$ より, 伊藤の公式から

$$\begin{aligned} |B_t| = F(B_t) &= |x| + \sum_{i=1}^N \int_0^t \frac{B_s^i}{|B_s|} dB_s^i + \frac{1}{2} \sum_{i=1}^N \int_0^t \frac{|B_s|^2 - (B_s^i)^2}{|B_s|^3} ds \\ &= |x| + \beta_t + \frac{1}{2} \int_0^t \frac{N|B_s|^2 - \sum_{i=1}^N (B_s^i)^2}{|B_s|^3} ds \\ &= |x| + \beta_t + \frac{1}{2} \int_0^t \frac{(N-1)|B_s|^2}{|B_s|^3} ds \\ &= |x| + \beta_t + \frac{N-1}{2} \int_0^t \frac{ds}{|B_s|}. \end{aligned}$$

■

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) $F(x) = |x|^{2-N}$ と定めると $F \in C^\infty(\mathbb{R}^N \setminus \{0\})$ であり, $\frac{\partial F}{\partial x_i}(x) = \frac{(2-N)x_i}{|x|^N}$, $\frac{\partial^2 F}{\partial x_i^2}(x) = \frac{2-N}{|x|^N} \left(1 - \frac{N x_i^2}{|x|^2}\right)$. a.s. で任意の $t \geq 0$ に対し $B_t \in \mathbb{R}^N \setminus \{0\}$ より, 伊藤の公式と 4. の証明から

$$\begin{aligned} |B_t|^{2-N} = F(B_t) &= |x|^{2-N} + \sum_{i=1}^N \int_0^t \frac{(2-N)B_s^i}{|B_s|^N} dB_s^i + \frac{1}{2} \sum_{i=1}^N \int_0^t \frac{2-N}{|B_s|^N} \left(1 - \frac{N(B_s^i)^2}{|B_s|^2}\right) ds \\ &= |x|^{2-N} + \sum_{i=1}^N \int_0^t \frac{(2-N)B_s^i}{|B_s|^N} dB_s^i. \end{aligned}$$

4. の結果より $|B|^{2-N}$ は非負 CLM なので, Prop. 4.7(i) より $|B|^{2-N}$ は非負 supermartingale. ゆえに任意の $t \geq 0$ に対し

$$E[|B_t|^{2-N}] \leq E[|B_0|^{2-N}] = |x|^{2-N}$$

が成り立つので, $|B|^{2-N}$ は L^1 -bdd. よって Thm. 3.19 より $|B_\infty|^{2-N}$ が a.s. で存在する. ■

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)

■