

Todennäköisyysteorian luennot, kevät 2015

Dario Gasbarra¹

1. joulukuuta 2015

¹Helsingin Yliopisto, Matematiikan ja tilastotieteen laitos

Sisältö

0	Miksi todennäköisyydet ovat additiivisia ?	7
1	Kolmogorovin aksioomat.	25
1.1	Mitan laajennus	28
1.2	Sovellus: Tulo σ -algebra ja tulo-todennäköisyys	40
2	Todennäköisyys äärettömissä tulo-avaruuksissa ja Kolmogorovin laajennuslause	45
3	Satunnaismuuttujat	51
3.1	Satunnaismuuttujan jakauma	56
4	Odotusarvo ja Integraali	57
4.1	Monotonisen konvergenssin lause.	63
4.2	Odotusarvon sovellus: mitan vaihto	71
4.2.1	Uskottavuusosamäärä	72
4.2.2	Lebesguen hajotelma	73
5	Riippumattomuus	77
5.0.3	Lovaszin lokaali lemma	79
5.1	Borel Cantelli lemmat	83
6	Stokastinen konvergenssi	87
6.1	Funktionaalianalyysin peruskäsitteiden pika-sanasto	91

7	Fubinin lause ja tulo-todennäköisyys	93
7.0.1	Osittaisintegroinnin kaava	98
7.0.2	Muuttujan vaihto-kaava eukliidisessa avaruudessa \mathbb{R}^d	101
8	Tasainen integroituvuus ja $L^1(P)$-konvergenssi	105
8.0.3	Sovellus: odotusarvon derivointi parametrin suhteen	115
9	$L^p(\Omega)$ avaruudet	121
9.0.4	Epäyhtälöt	121
9.1	Projektio $L^2(P)$ avaruudessa	128
10	Ehdollinen odotusarvo	133
10.1	Ehdollinen odotusarvo Radon-Nykodim derivaattana . . .	135
10.2	Mitä voidaan sanoa kun $E_P(X) = \infty$?	136
10.3	Ehdollisen odotusarvon ominaisuudet	137
10.4	Säännöllinen ehdollinen todennäköisyys ja ytimet	138
10.5	Ehdollisen odotusarvon laskenta riippumattomuuden nojalla	142
10.6	Ehdollisen odotusarvon laskenta mitan-vaihdon avulla: Bayesin kaava	144
10.6.1	Ehdollisen odotusarvon laskenta tuloavaruudessa . .	146
10.7	Ehdollistaminen nollamittaisiin tapahtumiin: varoitus . . .	149
11	Martingaalit	153
12	Martingaalien konvergenssi	157
12.1	Doobin Martingaali-konvergenssi lause	157
12.1.1	Tasaisesti integroituvat martingaalit	160
12.1.2	Martingaalin takaperäinen konvergenssi	162
12.2	Vaihdeettavuus ja De Finettin lause	166
13	Radon-Nikodymin lause	175
14	Johdatus Cramerin suurten poikkeamien teoriaan	181

<i>SISÄLTÖ</i>	5
15 Jakaumien konvergenssi	191
15.0.1 Skorokhodin esitys	193
16 Keskeinen raja-arvo lause , Steinin todistus	203
17 Suurten satunnaismatriisien ominaisarvojen jakauma	215

Luku 0

Miksi todennäköisyydet ovat additiivisia ?

My Thesis, paradoxically and a little provocatively, but nonetheless genuinely, is simply this:

PROBABILITY DOES' NOT EXISTS.

The abandonment of superstitious beliefs about the existence of Phlogiston, the Cosmic Ether, Absolute Space and Time, . . . , or Faires and Witches was an essential step along the road on scientific thinking. Probability too, if regarded as something endowed with some kind of objective existence is no less a misleading misconception, an illusory attempt to exteriorize or materialize our true probabilistic beliefs. Bruno De Finetti, Theory of Probability, a critical introductory treatment (1972).

Aloitan tällä (ja lopetan saman tien) tätä pohdiskelua: On merkillistä että, matemaattisesta sivistyksestä riippumatta, todennäköisyyskäsite on kaikille tuttu: me kaikki ymmärrämme mitä jalkapallonvalmentaja tarkoittaa kun kertoo haastattelussa että hänen mielestä joukkueensa voittomahdollisuudet ovat noin 60% (vaikka me voimme olla eri mieltä luvusta ja todennäköisyyden filosofiasta).

Kuten meidän kauaiset esi-isämme, joudumme jatkuvasti tekemaan isompia tai pienempia päätöksiä epävarmuuden tilassa. Luonnon valinta on muokannut meidän aivoihimme vaistomaista älykkyyttä hahmotta-

maan ja vertailemaan eri mahdollisuuksien "uskottavuuksia", ottaamalla huomioon aikaisempaa kokemusta ja ympäristöltä tulevaa informaatiota.

Mittateoria saa uuden maun, koska sen ongelmat ja tulokset voidaan tulkita "jokamiehen" todennäköisyyskäsitteen valossa.

M. Kac sen lausui: "*Probability theory is measure theory with a soul*" eli ("*Todennäköisyysteoria on mittateoria jolla on sielua*").

Kun hypoteettiset avaruusolennot vihdoinkin saapuvat maahan ja ilmenee että he osaavat jo koko meidän matematiikkamme ja mittateoriamme, pystyisivätkö he silti ymmärtämään mitä todennäköisyys tarkoittaa meille ?

Todennäköisyys = Hinta Bruno De Finetti (1906-1985) oli matemaatikko, taloustieteilijä ja filosofi. Hänen tieteenfilosofiassa torjutaan absoluuttisen todennäköisyyden käsite. Sen sijaan todennäköisyydellä on puhtaasti operaativinen merkitys. Todennäköisyydet ovat aina suhteellisia, meidän tiedon tilasta riippuen.

Epävarmassa maailmassa, tapahtumat voidaan luokitella kahteen luokkaan, $\mathcal{V} = \{ \text{varmat tapahtumat} \}$ ja $\mathcal{E} = \{ \text{epävarmat tapahtumat} \}$.

Kun tapahtuma $E \in \mathcal{V}$ on varma ja $F \supseteq E$ eli F tapahtuu aina silloin kun E tapahtuu, seuraa että myös $F \in \mathcal{V}$ on varma. Tapahtuma E on mahdoton jos sen negaatio E^c (joka tapahtuu silloin kun E ei tapahdu) on varma.

Merkitään luokka $\mathcal{N} = \{ \text{mahdottomat tapahtumat} \}$ ja sanotaan että tapahtumat E, F ovat keskenään *ei sopivia* kun niiden yhteensattuma on mahdoton, eli $(E \cap F) \in \mathcal{N}$. Huomataan myös että jokaiselle tapahtumalle E , $(E \cup E^c) \in \mathcal{V}$. Kun E ja F ovat tapahtumia, $(E \cup F)$ merkitsee tapahtuman jossa E tai F tapahtuvat.

Eräs vedonlyöntimeklari ottaa vastaan vetoja tapahtumista E_1, \dots, E_n , jotka ovat keskenään ei-sopivia, siis $(E_i \cap E_j) \in \mathcal{N}$ (mahdoton tapahtuma) kun $i \neq j$. Tarkemmin, meklarin on pakko ottaa vastaan mitä tahansa vetoja (myös negatiivisilla panoksilla) tapahtumista $E_i, i = 1, \dots, n$, ja niiden yhdisteistä $(E_i \cup E_j), (E_i \cup E_j \cup E_k), \dots$ jne.

Meklari valitsee kuitenkin vetojen hinnat (tulkinta: **todennäköisyydet**) $Pr(E_i), Pr(E_i \cup E_j), Pr(E_i \cup E_j \cup E_k) \dots$ jne.

Merkinnät: $p_i := Pr(E_i)$, "satunnaissuure" $\mathbf{1}_{E_i}$ on tapahtuman E_i :n indikaattori joka saa arvon 1 jos "sattuma" E_i tapahtuu, muuten 0.

Pr lyhennys sopii hyvin molemmille englanninkielisille sanoille

Price = hinta ja Probability = todennäköisyys.

Vastapuolen voitto on satunnaissuure

$$V = (\mathbf{1}_{E_1} - p_1)y_1 + \dots + (\mathbf{1}_{E_n} - p_n)y_n$$

jossa $(y_1, \dots, y_n) \in \mathbb{R}^n$ on vastapuolen vapaasti valittavissa oleva vedonlyöntistrategia.

Johdonmukainen meklari määrää vedonlyönnin hinnat siten, että vastapuolelle ei syntyisi *arbitraasimahdollisuuksia*, eli mahdollisuuksia tehdä riskitöntä voittoa.

Teoreema 0.0.1. (Tämä on väite eikä määritelmä !)

Arbitraasivapausoletuksesta seuraa välittömästi:

1. Vetojen hinnat ovat yksikäsitteisiä (yhden hinnan laki), vedolle $\mathbf{1}_{E_i}$ on vain yksi hinta $Pr(E_i) \in [0, 1]$.
2. Jos $E_i \in \mathcal{V}$ (varma tapahtuma), $Pr(E_i) = 1$ ja vastaavasti jos $E_i \in \mathcal{N}$ (mahdoton tapahtuma), niin $Pr(E_i) = 0$.
3. Hinnat (eli todennäköisyydet) ovat (äärellisesti)-additiivisia.

Todistus :

1. Jos vedolle $\mathbf{1}_E$ olisi kaksi hintaa, $p_1 > p_2$, vastapuoli voisi ostaa meklarilta x vedonlyöntilippua hinnalla p_1 ja myydä meklarille x vedonlyöntilippua hinnalla p_2 , jossa $x > 0$ voi olla mielivaltainen suuri. Vastapuolen voitto (meklarin tappio) on kaikissa tapauksissa

$$(\mathbf{1}_E - p_1)x - (\mathbf{1}_E - p_2)x = (p_1 - p_2)x$$

2. Jos E on varma tapahtuma, ja vedolle $\mathbf{1}_E$ on hinta $p \neq 1$, vastapuolelle syntyy varmasti voitto

$$(\mathbf{1}_E - p)x = (1 - p)x$$

Kun $p > 1$ (vastaavasti $p < 1$) vastapuoli saa mielivaltainen suuri voittoa valitsemalla $x < 0$ (vastaavasti $p > 1$). Jos E on mahdoton tapahtuma, vastapuolen voitto on varmasti

$$(\mathbf{1}_E - p)x = -px$$

jossa $x < 0$ on mielivaltainen.

3. Olkoon ensin $n = 2$, $(E_1 \cap E_2) \in \mathcal{N}$,

sen lisäksi oletamme että $(E_1 \cup E_2) \in \mathcal{V}$ (eli on varma tapahtuma). Siitä seuraa $Pr(E_1 \cup E_2) = 1$. Linearisella systeemillä

$$\begin{cases} V(E_1) = (1 - p_1)y_1 - p_2y_2 = & \text{vastapuolen voitto kun } E_1 \text{ tapahtuu} \\ V(E_2) = -p_1y_1 + (1 - p_2)y_2 = & \text{vastapuolen voitto kun } E_2 \text{ tapahtuu} \end{cases}$$

on ratkaisu mille tahansa voitto-vektorille $(V(E_1), V(E_2))$ jos ja vain jos kertoimien matriisi on kääntyvä, eli

$$\det \begin{pmatrix} (1 - p_1) & -p_2 \\ -p_1 & (1 - p_2) \end{pmatrix} = 1 - p_1 - p_2 \neq 0$$

Estääkseen vastapuolta tekemistä riskitöntä voittoa, on välttämätöntä että

$$Pr(E_1) + Pr(E_2) = 1 = Pr(E_1 \cup E_2).$$

Kun $n > 2$, $E_i \cap E_j \in \mathcal{N}$ kun $i \neq j$ ja, $E_1 \cup E_2 \cup \dots \cup E_n \in \mathcal{V}$ (eli on varma), meklari on johdonmukainen jos ja vain jos

$$\det \begin{pmatrix} (1-p_1) & -p_2 & \dots & -p_n \\ -p_1 & (1-p_2) & \dots & -p_n \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ -p_1 & -p_2 & \dots & (1-p_n) \end{pmatrix} = 1 - p_1 - p_2 - \dots - p_n = 0$$

Tämä determinantti lasketaan induktiolla tai lineaari-algebran Sylvesterin lemman kautta:

Lemma 0.0.1. Jos A on $n \times m$ ja B on $m \times n$ matriisi, ja I_n on $n \times n$ identiteetti matriisi,

$$\det(I_n + AB) = \det(I_m + BA)$$

Yleisemmin, kun $(E_1 \cap E_2) \in \mathcal{N}$, koska $(E_1 \cup E_2 \cup (E_1 \cup E_2)^c) \in \mathcal{V}$, seuraa

$$1 = Pr(E_1) + Pr(E_2) + Pr((E_1 \cup E_2)^c) = Pr(E_1) + Pr(E_2) + (1 - Pr(E_1 \cup E_2))$$

$$\text{siis } Pr(E_1 \cup E_2) = Pr(E_1) + Pr(E_2) \quad \square$$

Oletetaan että meklari on hinnoitellut johdonmukaisesti keskenään eisopivia tapahtumia E_1, \dots, E_n ja niiden yhdisteitä hinnoilla $Pr(E_1), \dots, Pr(E_n)$, jossa P on äärellisesti additiivinen.

Käsitellään vielä monimutkaisempaa vedonlyöntisopimusta ("satunnaissuuretta")

$$X = \sum_{i=1}^n x_i \mathbf{1}_{E_i} = \sum_{x \in \mathbb{R}} x \mathbf{1}_{E_x}$$

jossa

$$E_x := \bigcup_{1 \leq i \leq n: x_i = x} E_i = (\text{"X saa arvon } x\text{"}).$$

ja $E_x = \emptyset$ jos $x \neq x_i \forall i$.

Vedonlyönninsopimus X maksaa vastapuolelle etukäteen sovittua summaa $x_i \in \mathbb{R}$ silloin kun "sattuma" E_i tapahtuu.

Tämä sopimus on "toistettavissa" vedonlyönnin strategialla (x_1, \dots, x_n) .

Koska arbitraasivapaassa hinnoittelusysteemissä hinnat ovat yksikäsitteisiä, seuraa että X :n ainoa johdonmukainen hinta (tulkinta: satunnaisuuden odotusarvo, englanniksi Expectation) on

$$\mathbb{E}_{Pr}(X) := \sum_{i=1}^n x_i Pr(E_i) = \sum_{x \in \mathbb{R}} x Pr(E_x).$$

- Odotusarvo on lineaarinen: kun a, b ovat vakioita ja X, Y satunnaisia,

$$E_{Pr}(aX + bY) = aE_{Pr}(X) + bE_{Pr}(Y)$$

- Odotusarvo on positiivinen: jos $(X \geq 0)$ on varma tapahtuma Pr todennäköisyyden suhteen, eli $Pr(X \geq 0) = 1$, seuraa

$$E_{Pr}(X) \geq 0$$

Huomautus 0.0.1. Olkoon

$$\mathcal{X} \subseteq \left\{ \sum_{i=1}^n x_i \mathbf{1}(E_i) : n \in \mathbb{N}, x_i \in \mathbb{R} \right\}$$

vedonlyönninsopimusten osajoukko.

Matemaattisessa rahoitusteoriassa, karakterisoidaan arbitraasivapaita hintasysteemejä

$$c = (c(X) : X \in \mathcal{X})$$

Lause 0.0.1. (Rahoitusteorian ensimmäinen päälause) Hintasysteemi $c(\cdot)$ on arbitraasi-vapaa jos ja vain jos on olemassa hinnoittelu-todennäköisyys Pr , jolla $Pr(E) = 0 \iff E \in \mathcal{N}$, ja kaikille $X \in \mathcal{X}$

$$c(X) = \mathbb{E}_{Pr}(X) = \sum_x x Pr(X = x).$$

Yleisesti Pr ei tarvitse olla yksikäsitteinen, voi olla useita hinnoittelutodennäköisyyksiä jotka generoivat samaa hintasysteemiä $c(\cdot)$.

Todistus (\Leftarrow): Olkoon X_1, \dots, X_m satunnaisuureita ja Pr hinnoittelu-todennäköisyys, joka määrää hintasysteemiä

$$c_k = E_{Pr}(X_k) = \sum_{x \in \mathbb{R}} x Pr(X_k = x), \quad k = 1, \dots, m.$$

Tässä oletamme että $\{x : Pr(X_k = x) > 0\}$ on äärellinen, $\forall k = 1, \dots, m$.

Olkoon $y = (y_1, \dots, y_k) \in \mathbb{R}^k$ vedonlyönti strategia jolla tapahtuma

$$\left\{ \sum_{k=1}^m y_k (X_k - c_k) \geq 0 \right\} \in \mathcal{V}$$

on varma.

$$E_{Pr} \left(\sum_{k=1}^m y_k (X_k - c_k) \right) = \sum_{k=1}^m \left(E_{Pr}(X_k) - c_k \right) = 0$$

seuraa että

$$\left\{ \sum_{k=1}^m y_k (X_k - c_k) > 0 \right\} \in \mathcal{N}$$

on mahdoton, koska muuten

$$Pr \left(\sum_{k=1}^m y_k (X_k - c_k) > 0 \right) > 0$$

josta seuraa ristiriita

$$\begin{aligned} 0 &= \sum_{k=1}^m \left(E_{Pr}(X_k) - c_k \right) = E_{Pr} \left(\sum_{k=1}^m y_k (X_k - c_k) \right) \\ &= E_{Pr} \left(\left(\sum_{k=1}^m y_k (X_k - c_k) \right) \mathbf{1}_{\left\{ \sum_{k=1}^m y_k (X_k - c_k) > 0 \right\}} \right) > 0. \end{aligned}$$

Implikaatio (\Rightarrow) osoitetaan rahoitusteorian kurssilla konveksianalyysin argumentilla \square

Arbitraasi-vapaassa tilanteessa, hinnoittelu-todennäköisyyden Pr :n avulla, määrittelemällä

$$c(Y) = \mathbb{E}_{Pr}(Y) = \sum_i y_i Pr(E_i)$$

laajennetaan alkuperäistä hintasysteemiä säilyttämällä arbitraasivapautta.

Kun on olemassa, hinnoittelutodennäköisyys Pr ei tarvitse olla yksikäsitteinen, siis jos hinta-systeemi $(c(X) : X \in \mathcal{X})$ on arbitraasi-vapaa, sillä voi olla useita arbitraasi-vapaita laajennuksia.

Huomautus 0.0.2. Tässä johdannossa emme ole vielä paljastaneet että Kolmogorovin todennäköisyyden aksiomeissa tapahtumat E_i tulevat olemaan jonkun pistetapahtumien avaruuden Ω :n osajoukkoja. Sen sijaan De Finetti kannatti minimaalista lähestymistapaa, jossa pistetapahtumien avaruutta Ω ei edes tarvita.

Todennäköisyys logiikan laajenuksena¹ Vuonna 1949 fyysikko R.T. Cox osoitti miten De Finettin additiivisen todennäköisyyden aksiomat seuraavat kun laajennetaan perinteistä logikkaa epävarmoihin väitteisiin pitämällä kiinni minimaalisista tervejärkisistä ehdoista.

Olkoon A, B, C väitteitä (tapahtumia), I merkitsee (sinun) taustatietoa. Notatio

$$(A|I) \geq (B|I)$$

tarkoittaa että taustatiedon I :n perusteella väite A on (sinulle) yhtä uskottava tai uskottavampi kuin B väiteettä.

- Vaatimus 1): \geq relaatio on täydellinen järjestys, eli on *transitiivinen*

$$(A|I) \geq (B|I) \text{ ja } (B|I) \geq (C|I) \text{ seuraa } (A|I) \geq (C|I), \quad (0.0.1)$$

ja taustatiedolla I kaikki väitteet ovat verrattavissa, eli

$$(A|I) \geq (B|I) \text{ tai } (B|I) \geq (A|I) \quad (0.0.2)$$

Kun molemmat ovat voimassa $(B|I) = (A|I)$, eli taustatiedolla I , väitteet A ja B ovat sinulle yhtä uskottavia.

¹Tämä kappale voidaan sivuuttaa

Koska väitteiden järjestys on täydellinen, taustatiedon I :n perusteella voidaan asentaa jokaiselle väitteelle A uskottavuusaste joka on reaali-luku jota merkitsemme aluksi samalla notaatiolla $(A|I)$. Väitteiden järjes-tys palautuu reaali-lukujen järjestykseen. Tämä uskottavuusaste-funktio ei ole tietenkään yksikäsitteinen. Näytämme että on olemassa funktionaali $\pi(A|I)$ joka säilyttää \geq järjestyksen ja toteuttaa De Finettin additiivisen to-dennäköisyyden vaatimukset.

Jatkossa merkitään $AB = A \cap B$.

- Vaatimus 2) On olemassa kuvaus $F(x, y)$ joka on kasvava ja derivoi-tuva ja x, y :n suhteen

$$(AB|I) = F((A|I), (B|A, I)) = F((B|I), (A|B, I))$$

Siis $(A|I)$ ja $(B|AI)$ määrävät $(AB|I)$ terveen järjen mukaisesti, ja jou-dutaan samaan arvoon arvioimalla ensin $(B|I)$ ja sitten $(A|B, I)$.

Erityisesti

$$(ABC|I) = F(F(x, y), z) = F(x, F(y, z)) \quad (0.0.3)$$

$$= F(u, z) = F(x, v) \quad (0.0.4)$$

jossa $x = (A|I), y = (B|A, I), z = (C|AB, I), u = F(x, y), v = F(y, z)$

Lemma 0.0.2. *Vaatimuksista seuraa että on olemassa kasvava kuvaus $w : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ jolla $w(F(x, y)) = w(x) + w(y)$*

Tod. Olkoon $F_1(x, y), F_2(x, y)$ osittaisderivaatat. Derivoimalla 0.0.3 saa-

daan

$$\begin{aligned} \frac{\partial(F(F(x, y), z))}{\partial x} &= \frac{\partial(F(x, F(y, z)))}{\partial x} \\ \iff F_1(u, z)F_1(x, y) &= F_1(x, v), \\ \frac{\partial(F(F(x, y), z))}{\partial y} &= \frac{\partial(F(x, F(y, z)))}{\partial y} \\ \iff F_1(u, z)F_2(x, y) &= F_2(x, v)F_1(y, z), \\ \frac{F_2(x, y)}{F_1(x, y)} &= \frac{F_2(x, v)}{F_1(x, v)}F_1(y, z) \\ \iff G(x, y) &= G(x, v)F_1(y, z) \\ \iff G(x, v)F_2(y, z) &= G(x, y)G(y, z) \text{ jossa } G(x, y) := \frac{F_2(x, y)}{F_1(x, y)} \end{aligned}$$

Derivoimalla seuraa

$$\begin{aligned} 0 &= \frac{\partial}{\partial z} \left(G(x, v)F_1(y, z) \right) = G_2(x, v)F_2(y, z)F_1(y, z) + G(x, v)F_{12}(y, z) \\ &= \frac{\partial}{\partial y} \left(G(x, v)F_2(y, z) \right) = \frac{\partial}{\partial y} \left(G(x, y)G(y, z) \right) \end{aligned}$$

eli $G(x, y)G(y, z)$ ei riipu y :stä. Tämä pätee jos ja vain jos G on muotoa

$$G(x, y) = r \frac{H(x)}{H(y)}$$

Tästä seuraa

$$F_1(y, z) = \frac{H(v)}{H(y)} \quad F_2(y, z) = r \frac{H(v)}{H(z)}$$

Seuraa

$$\begin{aligned} dv &= dF(y, z) = F_1(y, z)dy + F_2(y, z)dz \\ \iff \frac{1}{H(v)}dv &= \frac{1}{H(y)}dy + r \frac{1}{H(z)}dz \end{aligned}$$

Olkoon

$$W(x) := \exp\left(\int_{-\infty}^x \frac{1}{H(t)} dt\right)$$

Seuraa kun $v_0 = F(y_0, z_0)$

$$\begin{aligned} \frac{W(F(y, z))}{W(F(y_0, z_0))} &= \frac{W(v)}{W(v_0)} = \exp\left(\int_{v_0}^v \frac{1}{H(t)} dt\right) = \exp\left(\int_{F(y_0, z_0)}^{F(y, z)} \frac{1}{H(t)} dt\right) = \\ &= \exp\left(\int_{y_0}^y \frac{1}{H(t)} dt + r \int_{z_0}^z \frac{1}{H(s)} ds\right) = \exp\left(\int_{y_0}^y \frac{1}{H(t)} dt\right) \exp\left(r \int_{z_0}^z \frac{1}{H(s)} ds\right) = \\ &= \frac{W(y)}{W(y_0)} \left(\frac{W(z)}{W(z_0)}\right)^r \\ &\iff W(v) = W(F(y, z)) = cW(y)W(z)^r \\ &\text{jossa } c = \frac{W(F(y_0, z_0))}{W(y_0)W(z_0)^r} \text{ on vakio} \end{aligned}$$

Yhtälöstä 0.0.3

$$W(F(x, v)) = cW(x)W(v)^r = W(F(u, z)) = cW(u)W(z)^r$$

Tästä sijoittamalla $W(v) = cW(y)W(z)^r$ saadaan

$$\begin{aligned} W(x)c^r W(y)^r W(z)^{r^2} &= W(u)W(z)^r = W(F(x, y))W(z)^r = W(x)W(y)^r W(z)^r \\ &\iff cW(z)^r = W(z) \quad \forall z \end{aligned}$$

joka pätee jos ja vain jos $r = c = 1$, eli

$$W(F(x, y)) = W(x)W(y)$$

Ottamalla $w(x) := \log(|W(x)|)$, saadaan

$$\begin{aligned} w(F(x, y)) &= \log(|W(F(x, y))|) = \log(|W(x)W(y)|) \\ &= \log(|W(x)|) + \log(|W(y)|) = w(x) + w(y) \quad \square \end{aligned}$$

Huomataan että $w(A|I)$ säilyttää uskottavuusjärjestyksen, se mittaa väitteiden uskottavuutta eri asteikolla.

- Vaatimus 3) On olemassa kuvaus $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ jolla $w(\bar{A}|I) = f(w(A|I))$, jossa \bar{A} on väitteen A :n negaatio.

Tästä seuraa $f(f(x)) = x$. Oletetaan nyt että $\overline{B} \implies A$, josta seuraa $\overline{BA} = \overline{B}$.

$$\begin{aligned}
 w(AB|I) &= w(A) + w(B|AI) \\
 &= w(A) + f(w(\overline{B}|AI)) \\
 &= w(A) + f(w(\overline{BA}|I) - w(A|I)) \\
 &= w(A) + f(w(\overline{B}|I) - w(A|I)) \\
 &= w(A) + f(f(w(B|I)) - w(A|I)) \\
 &= x + f(f(y) - x) \\
 &= y + f(f(x) - y)
 \end{aligned}$$

jossa $x = w(A), y = w(B|I)$

ja viimeinen yhtälö seuraa vaihtamalla A ja B :n roolit.

Lemma 0.0.3. *On olemassa $c > 0$ jolla*

$$f(x) = \frac{1}{c} \log(1 - \exp(cx))$$

Tod. Olkoon

$$\begin{aligned}
 u &:= f(y) - x, & v &:= f(x) - y, \\
 x + f(u) &= y + f(v) \\
 \frac{\partial(x + f(u))}{\partial x} &= 1 - f'(u) = \frac{\partial(y + f(v))}{\partial x} = f'(v)f'(x) \\
 \frac{\partial(x + f(u))}{\partial y} &= f'(u)f'(y) = \frac{\partial(y + f(v))}{\partial x} = 1 - f'(v) \\
 \frac{\partial^2(x + f(u))}{\partial y \partial x} &= -f''(u)f'(y) = -f''(v)f'(x) \\
 \iff \frac{f''(u)}{f'(u)(1 - f'(u))} &= \frac{f''(v)}{f'(v)(1 - f'(v))} = c
 \end{aligned}$$

Ratkaistaan differentiaaliyhtälö

$$\frac{f''(x)}{f'(x)} = \frac{d}{dx} \log(|f'(x)|) = c(1 - f'(x))$$

integroimalla

$$\begin{aligned}
 \log(f'(x)) &= \log(f'(x_0)) + c \int_{x_0}^x (1 - f'(t)) dt = \\
 \log(f'(x_0)) + c((x - x_0) - (f(x) - f(x_0))) &= a + c(x - f(x)) \\
 f'(x) &= A \exp(c(x - f(x))) \\
 \exp(cf(x)) df(x) &= A \exp(cx) dx \\
 d \exp(cf(x)) &= \frac{A}{c} \exp(cx) dx \\
 \exp(cf(x)) &= \exp(cf(x_0)) + \frac{A}{c} \int_{x_0}^x \exp(ct) dt = \\
 &= \exp(cf(x_0)) + \frac{A}{c^2} (\exp(cx) - \exp(cx_0)) = k + B \exp(cx) \\
 \implies f(x) &= \frac{1}{c} \log(k + b \exp(cx))
 \end{aligned}$$

Koska

$$x + f(f(y) - x) = y + f(f(x) - y)$$

saadaan

$$\begin{aligned}
 x + \frac{1}{c} \log(k + b \exp(\log(k + b \exp(cy)) - cx)) &= \\
 x + \frac{1}{c} \log(k + b(k + b \exp(cy)) \exp(-cx)) &= \\
 x + \frac{1}{c} \log(k + bk \exp(-cx) + b^2 \exp(c(y - x))) &= \\
 = \frac{1}{c} \log(k \exp(cx) + bk + b^2 \exp(cy)) = \frac{1}{c} \log(k \exp(cy) + bk + b^2 \exp(cx))
 \end{aligned}$$

josta seuraa että $b^2 = k$, siis

$$f(x) = \frac{1}{c} \log(b^2 + b \exp(cx))$$

Koska $f(f(x)) = x$,

$$\frac{1}{c} \log(b^2 + b^3 + b^2 \exp(cx)) = x \quad \forall x$$

seuraa $b^2 + b^3 = 0$ ja $b^2 = 1$, josta seuraa $b = -1$ ja

$$f(x) = \frac{1}{c} \log(1 - \exp(cx)) \quad \square$$

Otetaan uusi uskottavuus-skaala $Pr(A|I) = \exp(cw(\bar{A}|I))$. Seuraa lem-
masta että

$$Pr(A|I) = 1 - Pr(\bar{A}),$$

$$Pr(\bar{A}|I) \in [0, 1]$$

$$Pr(AB|I) = Pr(A|I)Pr(B|A, I) = Pr(B|I)Pr(A|B, I)$$

Kutsutaan $Pr(A|I)$ väitteen A :n todennäköisyydeksi taustatiedolla I .

Huomataan että uskottavuutta voidaan mitata eri skaalalla, säilyttä-
mällä järjestyksen, esimerkiksi vedonlyöntisuhteen (englanniksi odds ra-
tio) skaalalla:

$$\phi(A|I) = \frac{Pr(A|I)}{1 - Pr(A|I)} \in \mathbb{R}$$

Vedonlyöntisuhde ei sovi vedonlyönnin hinnaksi, koska ei täytä De Finet-
tin additiivisuuden vaatimusta.

Todennäköisyyskaala on laskennallisesti kätevämpi, laskenta perus-
tuu tulon ja summan operaatioihin:

$$Pr(A + B|I) = Pr(A|I) + Pr(B|I) \quad \text{kun } B \subseteq \bar{A},$$

$$Pr(AB|I) = Pr(A|I)Pr(B|AI) = Pr(B|I)Pr(A|BI)$$

Huomautus 0.0.3. *Todennäköisyys on aina ehdollinen todennäköisyys, joka riip-
puu taustatiedoista. Uskottavuus-järjestys määrää todennäköisyyden yksikäsit-
teisesti. Mittapuuna voidaan käyttää hypoteettista arpajaispeliä, arpalipuilla $\{1, 2, \dots, N\}$
jossa X on ensimmäiseksi arvottu arpa.*

Olkoon väite $A_k = \{X = k\}$, ja oletamme että $(A_k|I) = (A_\ell|I) \forall k, \ell$ eli
(sinun mielestä taustatietojen perusteella) kaikki arpajaispelin tulokset ovat yh-
tä uskottavia. Tämä symmetriaa kutsutaan yhdentekevyyden periaatteeksi.
Symmetriasta ja additiivisuudesta ja seuraa välittömästi että todennäköisyysas-
teikolla $Pr(A_k|I) = 1/N$.

Tämän hypoteettisen pelin todennäköisyyksiä voidaan sitten käyttää mittapuuna. Olkoon B väite, jolla ei tarvitse olla tekemisessä meidän hypoteettisen arpapelin kanssa, ja

$$M := \min \left\{ 1 \leq k \leq N : (B|I) \leq (A_1 + \cdots + A_k|I) \right\}$$

Seuraa

$$\frac{(M-1)}{N} < Pr(B|I) \leq \frac{M}{N}$$

Silloin kun N kasvaa, nähdään että väitteiden uskottavuuden järjestys määrää yksikäsitteisesti $Pr(B|I)$.

Huomataan kuitenkin että samalla taustatiedolla eri henkilöt saattavat asettaa väitteitä eri uskottavuusjärjestykseen, siksi todennäköisyys ei ole yksikäsitteinen. Objektiiivisessa Bayes-teoriassa valitaan todennäköisyysmitta joka on vähiten informatiivinen (jolla on maksimaalinen entropia) olleessaan yhteensopiva taustatietojen kanssa.

Kirjallisuutta

- [1] Jaynes ET, *Probability theory, the logic of science*. Cambridge 2003.
- [2] Sivia DS, Skilling J: *Data Analysis, a Bayesian tutorial*. 2nd edition Oxford 2006
- [3] De Finetti B: *Theory of probability: a critical introductory treatment* Wiley 1972

Luku 1

Kolmogorovin aksioomat.

De Finetti osoitti, että ainoa johdonmukainen tapa hinnoitella epävarmoja tapahtumia on additiivisella todennäköisyydellä. Filosofisesti voidaan kiistaanalaistaa numeroituvan additiivisuuden aksiooman tarpellisuus, näin teki De Finetti joka kehitti oman äärellisesti-additiivisen todennäköisyyden teorian. Kuitenkin, todennäköisyyden numeroituva- eli σ -additiivisuus on luonteva oletus rajatapahtumien käsittelemisessä.

Vuonna 1933, venäläinen matemaatikko Andrey Nikolaevich Kolmogorov (1903-1987) julkaisi teoksen *Foundation of the Theory of Probability*, joka sisälsi modernin todennäköisysteorian aksioomeja, todennäköisyyden konstruktioita ääretön-ulotteisessa tuloavaruudessa, sekä ehdollisen todennäköisyyden yleistä teoriaa.

Määritelmä 1.0.1 (Algebrat ja σ -algebrat). *Olkoon Ω abstrakti joukko. 2^Ω on Ω :n potenssijoukko, eli kaikkien Ω :n alijoukkojen kokoelma.*

Olkoon $\mathcal{A} \subseteq 2^\Omega$ (mahdollisesti pienempi) alijoukkojen perhe. Sanotaan

• *\mathcal{A} algebraksi kun*

1. $\Omega \in \mathcal{A}$
2. $A \in \mathcal{A} \implies A^c = (\Omega \setminus A) \in \mathcal{A}$
3. $A, B \in \mathcal{A} \implies (A \cup B) \in \mathcal{A}$

Kun huomataan että $A \cap B = (A^c \cup B^c)^c$, määritelmästä seuraa että algebra on suljettu äärellisten leikkauksen ja yhdisteen operaatioiden suhteen.

- Algebra \mathcal{A} on σ -algebra kun se on suljettu numeroituvan yhdisteen suhteen

$$\{A_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{A} \implies \left(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n \right) \in \mathcal{A}$$

Seuraa että σ -algebra on suljettu myös numeroituvan leikkauksen suhteen.

- Pari (Ω, \mathcal{A}) jossa \mathcal{A} on Ω :n σ -algebra kutsutaan mitta-avaruudeksi tai todennäköisyysavaruudeksi.
- σ -algebran jäseniä $A \in \mathcal{A}$ kutsutaan mitallisiksi joukoiksi tai tapahtumiksi.

Määritelmä 1.0.2. Olkoon (Ω, \mathcal{A}) todennäköisyysavaruus, jossa \mathcal{A} on Ω :n σ -algebra.

- Kuvaus $\mu : \mathcal{A} \rightarrow [0, +\infty]$ on (positiivinen) **mitta** kun $\mu(\emptyset) = 0$ ja μ on σ -additiivinen, eli kaikille jonoille $\{A_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{A}$ joilla $A_n \cap A_m = \emptyset \quad \forall m \neq n$,

$$\mu\left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n\right) = \sum_{n=1}^{\infty} \mu(A_n)$$

- Mitta μ on **äärellinen** kun $\mu(\Omega) < +\infty$, ja on **σ -äärellinen** jos on olemassa numeroituva mitallinen peite $\{\Omega_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{A}$ jolla

$$\Omega = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} \Omega_n \quad \text{ja} \quad \mu(\Omega_n) < \infty \quad \forall n.$$

- Positiivinen mitta μ on **todennäköisyysmitta** kun $\mu(\Omega) = 1$.

Huomautus 1.0.4. Normalisoimalla, saadaan äärellisestä mitasta μ todennäköisyysmitta:

$$P(A) := \frac{\mu(A)}{\mu(\Omega)}$$

Tehtävä 1.0.1. Äärellisesti additiivinen todennäköisyys voi olla melko erikoinen: Olkoon $\Omega = \mathbb{N}$,

$$\mathcal{A} = \{A \subseteq \mathbb{N} : A \text{ tai } A^c \text{ on äärellinen}\}$$

$$\mu : \mathcal{A} \rightarrow [0, 1], \quad \mu(A) = \begin{cases} 0 & \text{jos } A \text{ on äärellinen} \\ 1 & \text{jos } A^c \text{ on äärellinen} \end{cases}$$

Osoita että

- \mathcal{A} on algebra mutta ei ole σ -algebra.
- μ on äärellisesti additiivinen mutta ei σ -additiivinen todennäköisyys.

Huomautus 1.0.5. Potenssijoukko 2^Ω on σ -algebra. Onko mahdollista valita aina todennäköisyysavaruudeksi $(\Omega, 2^\Omega)$, ja määrittellä $P(B)$ jokaiselle alijoukolle $B \subseteq \Omega$?

On olemassa esimerkkejä (kts. Banachin ja Tarskin paradoksi) todennäköisyyskolmikosta (Ω, \mathcal{A}, P) , jossa todennäköisyysmitan P :n laajennus σ -additiiviseksi mitaksi $P^* : 2^\Omega \rightarrow [0, 1]$ ei ole olemassa. Kun Ω on ei-numeroituva, potenssijoukko saattaa olla liian suuri.

Esimerkki 1.0.1 (Vitali). Olkoon $\Omega = \mathbb{T} = \{z = e^{i\theta} : \theta \in [0, 2\pi)\}$, $\mathcal{A} = \mathcal{B}(\mathbb{T}) = \sigma(\mathbb{T}\text{:n avoimet välit})$ eli pienin σ -algebra joka sisältää kaikki ympyrän avoimet välit (z, w) (avoimet karteet).

Määrittellemme todennäköisyysmitan ensin avointen välien kautta

$$P((z, w)) = \frac{\text{pituus}((z, w))}{2\pi} = \frac{|\theta - \psi|}{2\pi}$$

jossa $w = e^{i\psi}$.

Caratheodoryn lauseen (1.1.1) avulla voidaan laajentaa P :n koko Borelin σ -algebralle $\mathcal{B}(\mathbb{T})$. Osoitamme kuitenkin että P ei laajene σ -additiiviseksi mitaksi koko potenssijoukolle 2^Ω .

Määritellään ekvivalenssirelaatio

$$z = e^{i\theta} \sim w = e^{i\psi} \iff \left(\frac{\theta - \psi}{2\pi} \right) \in \mathbb{Q}$$

Ylinumeroituvan valinnan aksiooman avulla voidaan valita jokaisesta ekvivalenssiluokasta yhden jäsenen ja muodostaa joukon E . Määritellään

$$E_q = \{ze^{i2\pi q} : z \in E\}, \quad q \in \mathbb{Q}.$$

Koska E koostuu ekvivalenssiluokkien edustajista, seuraa $E_0 = E$, $E_q = E_r$ kun $q \sim r$ ja $(E_q \cap E_r) = \emptyset$ kun $q \not\sim r \pmod{2\pi}$, jossa kun $q, r \in \mathbb{Q}$, $q \sim r \iff q = r \pmod{2\pi}$. Näillä notaatioilla,

$$\mathbb{T} = \bigcup_{q \in \mathbb{Q}/\sim} E_q.$$

Huomataan että mitta P on rotaatio-invariantti \mathbb{T} :n avoimille väleille ja niiden virittämällä σ -algebralla koska

$$\text{pituus}(z, w) = \text{pituus}(yz, yw) \text{ kun } y, z, w \in \mathbb{T}.$$

Jos $P(E)$ olisi hyvin määritelty, seuraisi $P(E_q) = P(E)$, mikä johtaa riistiriitaan, koska σ -additiivisuudesta seuraa

$$1 = P(\mathbb{T}) = P\left(\bigcup_{q \in \mathbb{Q}/\sim} E_q\right) = \sum_{q \in \mathbb{Q}/\sim} P(E_q) = \infty \times P(E) \quad \square$$

1.1 Mitan laajennus

Määritelmä 1.1.1. Olkoon P todennäköisyysmitta todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{A}) . Kun $A \in \mathcal{A}$ ja $P(A) = 1$ sanotaan, että A tapahtuu P -melkein varmasti (lyhennys: *m.v.*) ja A^c on P -nollajoukko.

Sen lisäksi jos $B \notin \mathcal{A}$ mutta $B \supseteq A$ (vastaavasti $B \subseteq A$) jossa $A \in \mathcal{A}$ ja $P(A) = 1$ (vastaavasti $P(A) = 0$), asetetaan $P(B) = 1$ (vastaavasti $P(B) = 0$).

Lemma 1.1.1 (mitan monotoninen suppeneminen). Olkoon $(\Omega, \mathcal{A}, \mu)$ mitta-avaruus. Olkoon $\{A_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{A}$ tapahtumien jono jolla $A_n \subseteq A_{n+1} \quad \forall n$,

$$A = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n \in \mathcal{A}, \text{ ja merkitään } A_n \uparrow A.$$

Silloin $\mu(A_n) \uparrow \mu(A)$ kun $n \uparrow \infty$.

Vastaavasti kun $B_n \supseteq B_{n+1} \in \mathcal{A} \quad \forall n$ ja

$$B = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} B_n \in \mathcal{A}, \text{ merkitään } B_n \downarrow B.$$

Silloin $\mu(B_n) \downarrow \mu(B)$.

Olkoon $C_{n+1} = A_{n+1} \setminus A_n \in \mathcal{A}$.

$$A = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} C_n \text{ jossa } C_i \cap C_j = \emptyset \text{ kun } i \neq j.$$

P mitan σ -additiivisuudesta

$$P(A) = \sum_{k=1}^{\infty} P(C_k) = \lim_{n \uparrow \infty} \sum_{k=1}^n P(C_k) = \lim_{n \uparrow \infty} P\left(\bigcup_{k=1}^n C_k\right) = \lim_{n \uparrow \infty} P(A_n) \quad \square$$

Toinen väite seuraa ottamalla komplementtijoukkoja, joilla

$$P(B^c) = (1 - P(B)).$$

Lemma 1.1.2. *P-nollajoukkojen numeroituva yhdiste on P-nollajoukko. P-melkein varma tapahtumien numeroituva leikkaus on P-melkein varma.*

Tehtävä 1.1.1. *Olkoon (Ω, \mathcal{A}) todennäköisyysavaruus, ja $P : \mathcal{A} \rightarrow [0, 1]$ additiivinen mitta. Osoita että P on σ -additiivinen jos ja vain jos*

$$\{B_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{A}, \quad B_n \downarrow \emptyset \implies P(B_n) \downarrow 0 \text{ kun } n \uparrow \infty$$

Määritelmä 1.1.2. *Olkoon (S, \mathcal{T}) Topologinen avaruus, jossa topologia \mathcal{T} koostuu kaikista S :n avoimista joukoista. **Borelin** σ -algebra $\mathcal{B}(S) := \sigma(\mathcal{T})$ on avointen joukkojen virittämä σ -algebra.*

$\mathcal{B}(S)$:n jäseniä kutsutaan Borelin joukoiksi. Koska yleinen Borelin joukko voi olla liian monimutkainen esitettäväksi, on hyödyllistä tietää yksinkertaisempi joukkoperhe joka virittää $\mathcal{B}(S)$:n numeroituvien yhdisteiden ja leikkausten kautta.

Tässä vaiheessa on hyvä palauttaa mieleen topologian aksioomat: \emptyset ja koko avaruus S ovat avoimia, avointen joukkojen mielivaltainen (myös ylinumeroituva) yhdiste on avoin, ja avointen joukkojen äärellinen leikkaus on avoin.

Esimerkki 1.1.1. *Olkoon $S = \mathbb{R}$, silloin*

$$\mathcal{A} := \sigma\{(-\infty, x] : x \in \mathbb{R}\} = \mathcal{B}(\mathbb{R})$$

Todistus: koska

$$(-\infty, x] = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} (-\infty, x + n^{-1})$$

on Borelin joukko, seuraa että $\mathcal{A} \subseteq \mathcal{B}(\mathbb{R})$. Kun $a < b$,

$$(a, b) = (-\infty, a]^c \cap \left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} (-\infty, b - n^{-1}] \right) \in \mathcal{A}$$

Olkoon $U \subseteq \mathbb{R}$ avoin. Jokaiselle $q \in U \cap \mathbb{Q}$ on olemassa $\varepsilon_q > 0$ jolla

$(q - \varepsilon_q, q + \varepsilon_q) \subseteq U$. Koska \mathbb{Q} on tiheä \mathbb{R} :ssa, seuraa että

$$U = \bigcup_{q \in U \cap \mathbb{Q}} (q - \varepsilon_q, q + \varepsilon_q)$$

jossa yhdiste on numeroituva. Tästä seuraa että $U \in \mathcal{S}$ ja siksi $\mathcal{B}(\mathbb{R}) = \mathcal{A}$.

Mitan määräys ja laajennukset Tämä materiaali pohjautuu Williamsin kirjaan *Probability with Martingales*. Charatheodoryn lausetta voit myös lukea suomeksi Elfving ja Tuomisen kirjasta.

Määritelmä 1.1.3. Joukkoperhettä $\mathcal{D} \subseteq 2^\Omega$ kutsutaan d -luokaksi kun

1. $\Omega \in \mathcal{D}$.
2. $A, B \in \mathcal{D}, A \subseteq B \implies B \setminus A \in \mathcal{D}$.
3. $\{A_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{D}, A_n \uparrow A \implies A \in \mathcal{D}$.

Määritelmä 1.1.4. Joukkoperhe $\mathcal{I} \subseteq 2^\Omega$ kutsutaan π -luokaksi jos on suljettu äärellisen leikkauksen suhteen:

$$I_1, I_2 \in \mathcal{I} \implies I_1 \cap I_2 \in \mathcal{I}$$

Tehtävä 1.1.2. Mielivaltainen π (vastaavasti d)-luokkien, leikkaus on π (vastaavasti d)-luokka. Eli

$$d(\mathcal{C}) = \bigcap_{d\text{-luokat } \mathcal{I} \supseteq \mathcal{C}} \mathcal{I}$$

on pienin \mathcal{C} :n sisältävä d -luokka, ja

$$\pi(\mathcal{C}) = \bigcap_{\pi\text{-luokat } \mathcal{J} \supseteq \mathcal{C}} \mathcal{J}$$

on pienin \mathcal{C} :n sisältävä π -luokka. Myös

$$\sigma(\mathcal{C}) = \bigcap_{\sigma\text{-algebrat } \mathcal{A} \supseteq \mathcal{C}} \mathcal{A}$$

on pienin \mathcal{C} :n sisältävä σ -algebra.

Lemma 1.1.3 (Dynkin). 1. Joukkoperhe \mathcal{C} on σ -algebra jos ja vain jos on sekä π -luokka että d -luokka.

2. Jos \mathcal{I} on π -luokka, pienin d -luokka joka sisältää \mathcal{I} on σ -algebra, siis $d(\mathcal{I}) = \sigma(\mathcal{I})$

1. Tod. Selvästi σ -algebra on sekä d - että π -luokka. Toisinpäin riittää osoittaa, että numeroituvan yhdisteen ominaisuus on voimassa. Olkoon $\{B_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{C}$ oletuksesta seuraa että

$$A_n := B_1 \cup B_2 \cup \dots \cup B_n = (B_1^c \cap B_2^c \cap \dots \cap B_n^c)^c \in \mathcal{C}$$

$$A_n \uparrow A := \left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n \right) = \left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} B_n \right) \in \mathcal{C} \quad \square$$

2. Tod. Lemman ensimmäisestä osasta riittää osoittaa että $d(\mathcal{I})$ on π -luokka. Osoitetaan ensin että

$$\mathcal{D}_1 := \{B \in d(\mathcal{I}) : B \cap E \in d(\mathcal{I}) \forall E \in \mathcal{I}\}, \text{ jossa } \mathcal{I} \subseteq \mathcal{D}_1 \subseteq d(\mathcal{I})$$

on d -luokka:

$$\Omega \in \mathcal{D}_1, \text{ koska } \Omega \in d(\mathcal{I}), (\Omega \cap E) = E \in \mathcal{I} \forall E \in \mathcal{I}.$$

Jos $B_1 \subseteq B_2, B_i \in \mathcal{D}_1, i = 1, 2, (B_2 \setminus B_1) \in d(\mathcal{I}),$ ja $\forall E \in \mathcal{I}, (B_2 \setminus B_1) \cap E = (B_2 \cap E) \setminus (B_1 \cap E).$ Nyt $(B_i \cap E) \in d(\mathcal{I}), i = 1, 2$ (\mathcal{D}_1 määritelmä), ja koska $d(\mathcal{I})$ on d -luokka, seuraa että $(B_2 \setminus B_1) \cap E \in d(\mathcal{I}) \forall E \in \mathcal{I},$ siis $(B_2 \setminus B_1) \in \mathcal{D}_1.$

Samoin, kun $\{B_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{D}_1, B_n \uparrow B = \bigcup_n B_n$ ja $E \in \mathcal{I},$

$$B \cap E = \bigcup_n (B_n \cap E)$$

jossa $(B_n \cap E) \uparrow (B \cap E).$ Nyt $(B_n \cap E) \in d(\mathcal{I})$ (\mathcal{D}_1 -määritelmä) ja koska $d(\mathcal{I})$ on d -luokka seuraa että $(B \cap E) \in \mathcal{D}_1 \forall E \in \mathcal{I}.$ Siis on osoitettu että \mathcal{D}_1 on d -luokka. Koska $\mathcal{I} \subseteq \mathcal{D}_1 \subseteq d(\mathcal{I}),$ seuraa että $\mathcal{D}_1 = d(\mathcal{I}).$

Olkoon nyt

$$\mathcal{D}_2 := \{B \in d(\mathcal{I}) : B \cap A \in d(\mathcal{I}) \forall A \in d(\mathcal{I})\} \subseteq d(\mathcal{I})$$

Seuraa myös että $\mathcal{D}_2 \supseteq \mathcal{I}$, koska olemme osoittaneet että jos $E \in \mathcal{I}, B \in \mathcal{D}_1 = d(\mathcal{I})$ silloin $(E \cap B) \in d(\mathcal{I})$.

Kuten edellisissä askeleissa voidaan osoittaa että \mathcal{D}_2 on d -luokka, ja siksi $\mathcal{D}_2 = d(\mathcal{I})$. Tästä seuraa että d -luokka $d(\mathcal{I})$ on π -luokka, ja lemmän ensimmäisestä osasta seuraa että $d(\mathcal{I})$ on σ -algebra. Yleisesti $d(\mathcal{I}) \subseteq \sigma(\mathcal{I})$, koska $d(\mathcal{I})$ on σ -algebra joka sisältää \mathcal{I} , seuraa että $d(\mathcal{I}) \supseteq \sigma(\mathcal{I})$, siis $d(\mathcal{I}) = \sigma(\mathcal{I})$ \square

Lause 1.1.1 (Laajennuksen yksikäsitteisyys). *Olkoon \mathcal{I} π -luokka, $\mathcal{A} = \sigma(\mathcal{I})$, P ja Q todennäköisyysmittoja todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{A}) , jolla $P(\Omega) = Q(\Omega) = 1$ ja $P(I) = Q(I) \quad \forall I \in \mathcal{I}$. Silloin $P(A) = Q(A) \quad \forall A \in \mathcal{A}$.*

Tod. Olkoon

$$\mathcal{D} := \{A \in \mathcal{A} : Q(A) = P(A)\} \subseteq \mathcal{A}$$

\mathcal{D} on d -luokka: $\Omega \in \mathcal{D}$ (oletus) jos $A, B \in \mathcal{D}, A \subseteq B$,

$$P(B \setminus A) = P(B) - P(A) = Q(B) - Q(A) = Q(B \setminus A)$$

koska P, Q ovat todennäköisyysmittoja (Ω, \mathcal{A}) -avaruudessa.

Jos $A_n \uparrow A, A_n \in \mathcal{D}, A \in \mathcal{A}$, lemmasta (1.1.1) seuraa

$$P(A) = \lim_n P(A_n) = \lim_n Q(A_n) = Q(A)$$

josta seuraa että $A \in \mathcal{D}$. Koska \mathcal{D} on d -luokka, ja oletuksesta $\mathcal{D} \supseteq \mathcal{I}$ joka on π -luokka, Dynkin lemmasta 1.1.3 seuraa että $\mathcal{D} \supseteq \sigma(\mathcal{I}) = \mathcal{A}$, eli $\mathcal{D} = \mathcal{A}$ \square .

Esimerkki 1.1.2. *Kun $\Omega = \mathbb{R}$, joukkoperhe*

$$\mathcal{I} := \{(-\infty, t], t \in \mathbb{R}\}$$

on π -luokka, ja $\sigma(\mathcal{I}) = \mathcal{B}(\mathbb{R})$ (Borelin σ -algebra). Kun $F : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$, todennäköisyysavaruudessa $(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ on olemassa korkeintaan yksi todennäköisyysmitta P jolla $F(t) := P((-\infty, t]) \quad \forall t \in \mathbb{R}$.

Riittävät ja välttämättömät ehdot todennäköisyyssmitan P :n olemassaololle ovat:

kuvaus $F : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$ on ei-vähenevä, oikealta jatkuva ja $\lim_{t \uparrow +\infty} F(t) = 1$,
 $\lim_{t \uparrow +\infty} F(-t) = 0$.

Eugen Dynkin(1924-2014) oli Neuvostoliittolainen ja Ameriikkalainen matemaatikko. Hänellä on tuloksia todennäköisysteoriassa (Markovin prosessesesista), ja algebrassa (Lie ryhmistä, Lie algebroista).

Teoreema 1.1.1 (Caratheodoryn laajennuslause). Olkoon \mathcal{A}_0 Ω :n tapahtumien algebra, ja olkoon $\mathcal{A} = \sigma(\mathcal{A}_0)$.

Jos kuvaus $\lambda_0 : \mathcal{A}_0 \rightarrow [0, \infty]$ on σ -additiivinen, on olemassa yksikäsitteinen σ -additiivinen mittalaaajennus $\lambda : \mathcal{A} \rightarrow [0, \infty]$ jolla $\lambda(A) = \lambda_0(A) \quad \forall A \in \mathcal{A}_0$.

Tod. Laajennuksen yksikäsitteisyys on osoitettu lemmassa (1.1.1). Olemassaolon todistus on jaettu eri vaiheisiin:

Lemma 1.1.4. Olkoon $\mathcal{A}_0 \subseteq 2^\Omega$ algebra, ja mielivaltainen kuvaus $\lambda : \mathcal{A}_0 \rightarrow [0, +\infty]$ jolla $\lambda(\emptyset) = 0$.

Sanotaan että $L \in \mathcal{A}_0$ on λ -joukko jos se jakaa siististi \mathcal{A}_0 :n seuraavalla tavalla:

$$\lambda(A) = \lambda(A \cap L) + \lambda(A \cap L^c), \quad \forall A \in \mathcal{A}_0$$

- λ -joukkojen kokoelma \mathcal{L}_0 on algebra ja $\lambda : \mathcal{L}_0 \rightarrow [0, +\infty]$ on äärellisesti additiivinen.
- Jos $L_1, L_2, \dots, L_n \in \mathcal{L}_0$, $L_i \cap L_j = \emptyset$ kun $i \neq j$, $A \in \mathcal{A}_0$,

$$\lambda\left(\bigcup_{k=1}^n (L_k \cap A)\right) = \sum_{k=1}^n \lambda(L_k \cap A)$$

Tod. Selvästi Ω on λ -joukko ja λ -joukon komplementti on λ -joukko.

Olkoon L_1, L_2 λ -joukot. Osoitamme että $L = (L_1 \cap L_2) \in \mathcal{L}_0$

$L^c \cap L_2 = L^c \cap L_1$, $L^c \cap L_2^c = L_2^c$. Kun $A \in \mathcal{A}_0$, koska L_2 on λ -joukko

$$\lambda(A) = \lambda(L_2 \cap A) + \lambda(L_2^c \cap A)$$

$$\lambda(L^c \cap A) = \lambda(L_2 \cap (L^c \cap A)) + \lambda(L_2^c \cap (L^c \cap A)) = \lambda(L_2 \cap L_1^c \cap A) + \lambda(L_2^c \cap A)$$

$$\lambda(L_2 \cap A) = \lambda(L_1 \cap L_2 \cap A) + \lambda(L_1^c \cap L_2 \cap A) \quad (\text{koska } L_1 \text{ on } \lambda\text{-joukko})$$

Tästä seuraa

$$\begin{aligned}\lambda(A) &= \lambda(L_1 \cap L_2 \cap A) + \lambda(L_1^c \cap L_2 \cap A) + \lambda(L_2^c \cap A) \\ &= \lambda(L \cap A) + \lambda(L^c \cap A) - \lambda(L_2^c \cap A) + \lambda(L_2^c \cap A),\end{aligned}$$

siis $L = (L_1 \cap L_2)$ on λ -joukko. Komplementin avulla näemme että myös $(L_1 \cup L_2)$ on λ -joukko, siis \mathcal{L}_0 on algebra.

Kun $L_1, L_2 \in \mathcal{L}_0, L_1 \cap L_2 = \emptyset, A \in \mathcal{A}_0$, koska $L_1^c \supseteq L_2$,

$$\lambda(A \cap (L_1 \cup L_2)) = \lambda(A \cap (L_1 \cup L_2) \cap L_1) + \lambda(A \cap (L_1 \cup L_2) \cap L_1^c) = \lambda(A \cap L_1) + \lambda(A \cap L_2)$$

Äärellinen additiivisuus seuraa kun $A = \Omega$ \square .

Määritelmä 1.1.5. Olkoon (Ω, \mathcal{A}) todennäköisyysavaruus.

Kuvaus $\lambda : \mathcal{A} \rightarrow [0, +\infty]$ on ulkomitta (engl. outer measure) jos

1. $\lambda(\emptyset) = 0$,
2. $A_1 \subseteq A_2, A_i \in \mathcal{A}, i = 1, 2, \implies \lambda(A_1) \leq \lambda(A_2)$
3. λ on ali- σ -additiivinen: kun $\{A_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{A}$,

$$\lambda\left(\bigcup_n A_n\right) \leq \sum_n \lambda(A_n)$$

Esimerkki 1.1.3. Olkoon \mathcal{Q} todennäköisyyssmittojen kokoelma samalla todennäköisyysavaruudella (Ω, \mathcal{A}) . Silloin

$$\lambda(A) := \sup_{Q \in \mathcal{Q}} Q(A), \quad A \in \mathcal{A},$$

on ulkomitta (harjoitustehtävä).

Lemma 1.1.5 (Caratheodory). Olkoon λ -ulkomitta todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{A}) . Joukkoperhe

$$\mathcal{L} = \{L \in \mathcal{A} : L \text{ on } \lambda\text{-joukko}\}$$

on σ -algebra ja kuvaus $\lambda : \mathcal{L} \rightarrow [0, +\infty]$ on σ -additiivinen mitta.

Tod. Lemman (1.1.4) nojalla jää osoitettavaksi että kun $\{L_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{L}$, $L_i \cap L_j = \emptyset$ kun $i \neq j$, seuraa

$$L = \left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} L_n \right) \in \mathcal{L} \text{ ja } \lambda(L) = \sum_{n=1}^{\infty} \lambda(L_n) .$$

Koska λ on sub- σ -additiivinen, kun $A \in \mathcal{A}$

$$\lambda(A) \leq \lambda(A \cap L) + \lambda(A \cap L^c)$$

Olkoon $M_n := \bigcup_{k \leq n} L_k$. Lemmasta (1.1.4) seuraa että $M_n \in \mathcal{L}$ (koska \mathcal{L} on algebra), eli kaikille $A \in \mathcal{A}$

$$\begin{aligned} \lambda(A) &= \lambda(A \cap M_n^c) + \lambda(A \cap M_n) \geq \lambda(A \cap L^c) + \lambda(A \cap M_n) \\ &= \lambda(A \cap L^c) + \sum_{k=1}^n \lambda(A \cap L_k) \end{aligned}$$

koska λ on ali- σ -additiivinen \mathcal{A} :ssa ja äärellisesti additiivinen \mathcal{L} :ssa. Tämä pätee jokaiselle $n \in \mathbb{N}$ eli

$$\lambda(A) = \lambda(A \cap L^c) + \sum_{k=1}^{\infty} \lambda(A \cap L_k) \geq \lambda(A \cap L^c) + \lambda(A \cap L)$$

Ali-additiivisuudesta seuraa $\lambda(A) = \lambda(A \cap L) + \lambda(A \cap L^c)$, eli $L \in \mathcal{L}$. Kun sijoitetaan $A=L$, σ -additiivisuus seuraa

$$\lambda(L) = \sum_{k=1}^{\infty} \lambda(L_k) \quad \square$$

Caratheodoryn laajennuslauseen (1.1.1) todistus:

Olkoon $\mathcal{G} = 2^\Omega$, ja määritellään

$$\lambda(G) := \inf_{\{F_n\}} \sum_{n \in \mathbb{N}} \lambda_0(F_n) \quad \forall G \subseteq \Omega$$

jossa infimum otetaan yli tapahtumien jonot $\{F_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{A}_0$ jolla $\bigcup_n F_n \supseteq G$.

a) Kuvaus $\lambda : 2^\Omega \rightarrow [0, +\infty]$ on ulkomitta.

Tod. Selvästi $\lambda(\emptyset) = 0$ ja λ on kasvava. Olkoon jono $\{G_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq 2^\Omega$, ja $\varepsilon > 0$. Jokaiselle n :lle on olemassa jono $\{F_{n,k} : k \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{A}_0$ jolla

$$G_n \subseteq \bigcup_k F_{n,k} \quad \text{ja} \quad \lambda(G_n) \leq \sum_k \lambda_0(F_{n,k}) \leq \lambda(G_n) + \varepsilon 2^{-n}.$$

Olkoon $G = \bigcup_n G_n \subseteq \bigcup_n \bigcup_k F_{n,k}$. Koska joukot $\{F_{n,k} : n, k \in \mathbb{N}\}$ peittävät G :n

$$\lambda(G) \leq \sum_n \sum_k \lambda_0(F_{n,k}) \leq \sum_{n=1}^{\infty} \lambda(G_n) + \varepsilon$$

Koska $\varepsilon > 0$ oli mielivaltainen, ali- σ -additiivisuus seuraa.

Lemmasta (1.1.5) seuraa että λ on σ -additiivinen mitta todennäköisyssavaruudessa (Ω, \mathcal{L}) , jossa λ -joukkojen σ -algebra on

$$\mathcal{L} = \{L \subseteq \Omega : \lambda(G) = \lambda(G \cap L) + \lambda(G \cap L^c) \forall G \subseteq \Omega\}$$

Osoitan seuraavaksi että **b)** $\lambda(A) = \lambda_0(A)$ kun $A \in \mathcal{A}_0$ ja **c)** $\mathcal{A}_0 \subseteq \mathcal{L}$. Tästä seuraa että λ on λ_0 :n laajennusmitta todennäköisyssavaruuteen (Ω, \mathcal{L}) , jossa σ -algebra $\mathcal{L} \supseteq \sigma(\mathcal{A}_0) = \mathcal{A}$.

b) Kun $A \in \mathcal{A}_0$, $\lambda(A) \leq \lambda_0(A)$, koska triviaalisti $A_0 \subseteq A_0 \in \mathcal{A}_0$. Olkoon $A \subseteq \bigcup_n A_n$ jossa $A_n \in \mathcal{A}_0$. Koska \mathcal{A}_0 on algebra, voidaan olettaa että joukot $\{A_n\}$ ovat erillisiä,

muuten otetaan $A'_1 = A_1$, ja rekursiivisesti $A'_n = (A_n \setminus A'_{n-1})$. Silloin $(\bigcup_n A'_n) = (\bigcup_n A_n) \supseteq A$ ja koska \mathcal{A}_0 on algebra, $A'_n \in \mathcal{A}_0$.

$$\lambda_0(A) = \lambda_0\left(\bigcup_n (A \cap A_n)\right) \stackrel{(*)}{=} \sum_n \lambda_0(A \cap A_n) \leq \sum_n \lambda_0(A_n)$$

jossa (*) kohdalla tulee käyttöön laajennuslauseen oletus, $\lambda_0 : \mathcal{A}_0 \rightarrow [0, +\infty]$ on σ -additiivinen algebralla \mathcal{A}_0 . Ottamalla infimumin oikealta puolelta seuraa että $\lambda_0(A) \leq \lambda(A)$.

c) Olkoon $A \in \mathcal{A}_0$ ja $G \subseteq \Omega$.

$\forall \varepsilon > 0$, on olemassa jono $\{A_n\} \subseteq \mathcal{A}_0$ jolla $G \subseteq \bigcup_n A_n$ ja

$$\lambda(G) + \varepsilon \geq \sum_n \lambda_0(A_n).$$

Koska $A \in \mathcal{A}_0$ λ :n-määritelmästä

$$\sum_n \lambda_0(A_n) = \sum_n \lambda_0(A_n \cap A) + \sum_n \lambda_0(A_n \cap A^c) \geq \lambda(G \cap A) + \lambda(G \cap A^c)$$

koska joukot $\{(A_n \cap A)\}_{n \in \mathbb{N}}$ peittävät $(G \cap A)$:n ja joukot $\{(A_n \cap A^c)\}_{n \in \mathbb{N}}$ peittävät $(G \cap A^c)$. Koska $\varepsilon > 0$ oli mielivaltainen,

$$\lambda(G) \geq \lambda(G \cap A) + \lambda(G \cap A^c)$$

Koska $\lambda : 2^\Omega \rightarrow [0, +\infty]$ on ulkomitta ja siksi ali-additiivinen, yhtäsuuruus seuraa, eli $A \in \mathcal{L}$ \square

Esimerkki: Yleinen todennäköisyysmitta reaaliakselilla (Kuten esimerkissä 1.1.2) olkoon $\Omega = \mathbb{R}$ ja $\mathcal{F} = \mathcal{B}(\mathbb{R})$.

Olkoon $F : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$ kuvaus joka on

1. ei-vähenevä funktio
2. oikealta jatkuva eli $F(t+) := \lim_{u \downarrow t} F(u) = F(t) \forall t \in \mathbb{R}$.
3. $F(+\infty) := \lim_{t \uparrow +\infty} F(t) = 1, F(-\infty) := \lim_{t \downarrow -\infty} F(t) = 0$.

Seuraa että on olemassa yksikäsitteinen todennäköisyysmitta $P : \mathcal{B}(\mathbb{R}) \rightarrow [0, 1]$ jolla $P((a, b]) = (F(b) - F(a)), a < b \in \mathbb{R}$.

Tod. Yksikäsitteisyys seuraa lemmasta (1.1.2) koska $\{(a, b] : a < b \in \mathbb{R}\}$ on π -luokka. Olkoon \mathcal{A}_0 on kokoelma joukoista joilla on esitys

$$A = (c, \infty) \cup \bigcup_{k=1}^m (a_k, b_k]$$

jossa $m \in \mathbb{N}, a_k \leq b_k \in \mathbb{R}, c \in (-\infty, +\infty]$ jossa $(\infty, \infty) = \emptyset$.

\mathcal{A}_0 on algebra joka virittää Borelin σ -algebran $\mathcal{B}(\mathbb{R})$.

Määritellään kuvaus $P^{(0)} : \mathcal{A}_0 \rightarrow [0, 1]$

$$P^{(0)}(A) = \sum_{k=1}^m (F(b_k) - F(a_k)) .$$

$P^{(0)}(A)$ ei riipu A :n esityksestä, ja on additiivinen \mathcal{A}_0 algebrassa.

Kun osoitamme että $P^{(0)}$ on σ -additiivinen algebrassa \mathcal{A}_0 , Caratheodoryn laajennuslauseesta seuraa että on olemassa laajennus P koko Borelin σ -algebralle.

Tod. Vastaoletus: on olemassa ei-kasvava jono $A_n \in \mathcal{A}_0$, $A_n \supseteq A_{n+1}$, ja ϵ jolla $P^{(0)}(A_n) \geq 4\epsilon > 0 \forall n$. σ -additiivisuus on todistettu kun osoitamme

$$\bigcap_n A_n \neq \emptyset$$

Olkoon

$$A_n = \bigcup_{k=1}^{m_n} (a_k^n, b_k^n]$$

jossa $-\infty < a_k^n \leq b_k^n \leq a_{k+1}^n \leq b_{k+1}^n < +\infty$.

Olkoon $\epsilon > 0$. Oletuksesta (3) seuraa että on olemassa $z \geq 0$ jolla $F(-z) < \epsilon$ ja $(1 - F(z)) < \epsilon$.

Muuten olisi olemassa $\epsilon > 0$ jolla $\forall z \geq 0$ $F(-z) > \epsilon$ tai $F(z) < 1 - \epsilon$, joka on riistiriidassa oletuksen $F(-\infty) = 0$ ja $F(+\infty) = 1$ kanssa.

Koska F on oikealta jatkuva, on olemassa $x_k^n \in (a_k^n, b_k^n]$ jolla

$$F(x_k^n) \leq F(a_k^n) + \epsilon 2^{-(k+n)}$$

Olkoon

$$B'_n = \left(\bigcup_{k=1}^{m_n} (x_k^n, b_k^n] \cap [-z, z] \right) \subseteq A_n, \quad B_n = \left(\bigcap_{l \leq n} B'_l \right) \subseteq A_n$$

jossa $B_n \in \mathcal{A}_0$ ja $B_n \supseteq B_{n+1} \forall n$. Seuraa

$$A_n \setminus B_n = \bigcup_{l \leq n} (A_n \setminus B'_l) \subseteq \bigcup_{l \leq n} (A_l \setminus B'_l)$$

Koska P_0 on äärellisesti additiivinen \mathcal{A}_0 :ssa ,

$$\begin{aligned} P^{(0)}(A_n \setminus B_n) &\leq P^{(0)}((-z, z]^c) + \sum_{l=1}^n P^{(0)}((A_l \setminus B'_l) \cap (-z, z]) \\ &\leq P^{(0)}((-z, z]^c) + \sum_{l=1}^n \sum_{k=1}^{m_l} P^{(0)}((a_k^l, x_k^l]) \\ &= F(-z) + (1 - F(z)) + \sum_{l=1}^n \sum_{k=1}^{m_l} \{F(x_k^l) - F(a_k^l)\} \leq 2\epsilon + \epsilon \sum_{l=1}^n 2^{-l} \sum_{k=1}^{m_l} 2^{-k} \leq 3\epsilon, \end{aligned}$$

jossa geometriselle sarjalle pätee $\sum_{n=1}^{\infty} 2^{-n} = 1$. Tästä seuraa

$$P^{(0)}(B_n) = P^{(0)}(A_n) - P^{(0)}(A_n \setminus B_n) \geq (4 - 3)\varepsilon \quad \forall n$$

josta seuraa $B_n \neq \emptyset$. Olkoon \bar{B}_n joukon B_n sulkeuma, joka on pienin B_n sisältävä suljeuttu joukko, eli

$$\bar{B}_n = \bigcap_{B_n \subseteq C \text{ closed}} C$$

joka on suljettu koska suljettujen joukkojen mielivalitainen leikkaus on suljettu. Koska $B_n \supseteq B_{n+1} \neq \emptyset$, seuraa että myös $\bar{B}_n \supseteq \bar{B}_{n+1} \neq \emptyset$.

Tästä seuraa

$$\bigcap_n A_n \supseteq \bigcap_n \bar{B}_n \neq \emptyset$$

muuten kokoelma $\{(\bar{B}_n)^c = (\mathbb{R} \setminus \bar{B}_n) : n \in \mathbb{N}\}$ olisi kompaktin joukon $[-z, z]$ avoin peite ilman äärellistä alipeitettä:

$$[-z, z] \subseteq \bigcup_{n \in \mathbb{N}} (\bar{B}_n)^c$$

jossa $[-z, z] \supseteq \bar{B}_n \supseteq \bar{B}_{n+1} \neq \emptyset, \quad \forall n \in \mathbb{N} \quad \square$

Esimerkki 1.1.4. *Kun*

$$F(x) = \begin{cases} 0 & , -\infty < x \leq 0 \\ x & , 0 < x \leq 1 \\ 1 & , 1 < x < \infty \end{cases}$$

P on tasainen jakauma välissä $[0, 1]$, jolla

$$P((a, b]) = F(b) - F(a) = \min(b, 1) - \max(a, 0), \quad a < b.$$

Voidaan myös määritellä Lebesguen mitan koko reaali-akselille:

$$\lambda(A) := \sum_{z \in \mathbb{Z}} P(A + z), \quad A \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$$

jolla $\lambda((a, b]) = (b - a)$, $a < b$. Lebesguen mitta on σ -äärellinen ja siirto-invariantti $\lambda(A + x) = \lambda(A)$, $x \in \mathbb{R}$, $A \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$. **Todistus** Olkoon

$$\mathcal{D} = \{B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}) : \lambda(B) = \lambda(x + B) \quad \forall x \in \mathbb{R}\}$$

Koska $(a, b] \in \mathcal{D}$ ja välit muodostuvat π -luokkaa, jos osoitamme että \mathcal{D} on d -luokka, siitä seuraa että $\mathcal{D} = \mathcal{B}(\mathbb{R})$ ja väite on todistettu.

Koska $(\mathbb{R} + x) = \mathbb{R}$, on selvää että $\mathbb{R} \in \mathcal{D}$.

Jos $B \supseteq A$ ja $A, B \in \mathcal{D}$, koska $(A + x) \setminus (B + x) = (A \setminus B) + x$, seuraa

$$\begin{aligned} \lambda((B \setminus A) + x) &= \lambda((B + x) \setminus (A + x)) \\ &= \lambda(B + x) - \lambda(A + x) = \lambda(B) - \lambda(A) = \lambda(B \setminus A). \end{aligned}$$

Olkoon $A_n \subseteq A_{n+1}$, jossa $A_n \in \mathcal{D} \forall n$, ja $A = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n$. Huomataan että

$$x + A = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} (A_n + x)$$

ja $(x + A_n) \uparrow (x + A)$. Tästä seuraa

$$\lambda(x + A) = \lambda\left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} (A_n + x)\right) = \lim_n \lambda(A_n + x) = \lim_n \lambda(A_n) = \lambda(A),$$

eli $A \in \mathcal{D}$ joka on sitten d -luokka.

1.2 Sovellus: Tulo σ -algebra ja tulo-todennäköisyys

Olkoon $(\Omega', \mathcal{F}', P')$ ja $(\Omega'', \mathcal{F}'', P'')$ todennäköisyyskolmikot, ja olkoon $\Omega = \Omega' \times \Omega''$.

Tuloavaruus Ω varustetaan tulo- σ -algebralla

$$\tilde{\mathcal{F}} = \mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2 := \sigma(A \times B : A \in \mathcal{F}', B \in \mathcal{F}'',)$$

eli mitallisten joukkojen tulojen virittämä σ -algebra.

Olkoon

$$\mathcal{A} = \left\{ C \subseteq \tilde{\Omega} : C = \bigcup_{k=1}^m (A_k \times B_k) \text{ jossa } A \in \mathcal{F}', B \in \mathcal{F}'' \right\}$$

Selvästi \mathcal{A} on algebra ja $\sigma(\mathcal{A}) = \tilde{\mathcal{F}}$.

Määritellään ensin additiivinen kuvaus $P^{(0)} : \mathcal{A} \rightarrow [0, 1]$: kun

$$C = \bigcup_{k=1}^m (A_k \times B_k)$$

jossa $(A_k \times B_k) \cap (A_l \times B_l) = \emptyset$ kun $l \neq k$,

$$P^{(0)}(C) = \sum_{k=1}^m P'(A_k)P''(B_k),$$

joka ei riipu C :n esityksestä (harjoitustehtävä). Kun osoitamme että kuvaus $P^{(0)} : \tilde{\mathcal{A}} \rightarrow [0, 1]$ on myös σ -additiivinen, Caratheodoryn laajennuslauseesta seuraa että on olemassa yksikäsitteinen todennäköisyysmitan $\tilde{P}^{(0)}$ laajennus $\tilde{P} = (P_1 \otimes P_2) : \mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2 \rightarrow [0, 1]$ jolla $\tilde{P}^{(0)}(\tilde{A}) = \tilde{P}(\tilde{A})$ kun $\tilde{A} \in \tilde{\mathcal{A}}$. $(P_1 \otimes P_2)$ kutsutaan tulo-todennäköisyydeksi. Tulo mitan konstruktio yleistyy suora-induktiolla myös äärellisiin tuloavaruuksiin $\Omega_1 \times \Omega_2 \times \cdots \times \Omega_n$, ja myös silloin kun mitat ovat σ -äärellisiä (harjoitustehtävä).

Äärettömän ulotteisen tulomitan konstruktio myös onnistuu Kolmogorovin laajennuslauseen seurauksena, ainakin kun $\Omega = \mathbb{R}$ (tai yleisemmin kun Ω on Borelin avaruus, kts. luku 2).

Todistus Osoitetaan että $P^{(0)}$ on σ -additiivinen tapahtumien algebrassa \mathcal{A} ,

näytämme että kun jono $C_n \in \mathcal{A}$ ja $C_n \downarrow \emptyset$, siitä seuraa $P^{(0)}(C_n) \downarrow 0$.
Olkoon

$$C_n = \bigcup_{k=1}^{m_n} (A_{nk} \times B_{nk}) \in \mathcal{A} \quad (1.2.1)$$

jossa $A_{nk} \in \mathcal{F}_1$ ja $B_{nk} \in \mathcal{F}_2$, ja joukot $(A_{nk} \times B_{nk})$ $k = 1, \dots, m_n$ ovat erillisiä.

Huomataan että

- esitys (1.2.1) tapahtumalle C_n ei ole yksikäsitteinen,
- kuitenkin, tapahtuman tulo-mitta

$$P^{(0)}(C_n) = \sum_{k=1}^{m_n} P_1(A_{nk})P_2(B_{nk})$$

ei riipu tapahtuman esityksestä,

- on olemassa esitys jossa joukot $A_{nk} \in \mathcal{F}_1$ ovat erillisiä, ja sen lisäksi $\forall n, 1 \leq k \leq m_n$ on olemassa ℓ jolla $A_{n-1,\ell} \supseteq A_{n,k}$ ja $B_{n-1,\ell} \supseteq B_{n,k}$.

Määritellään funktio $f_n : \Omega' \rightarrow [0, 1]$

$$f_n(\omega') = \sum_{k=1}^{m_n} P_2(B_{nk}) \mathbf{1}_{A_{nk}}(\omega')$$

jossa A_{nk} ovat erillisiä. Osoitamme että $\forall \omega' \in \Omega', f_n(\omega') \downarrow 0$ kun $n \uparrow \infty$.

Muuten $f_n(\omega') \not\rightarrow 0$, ja olisi olemassa ei-kasvava tapahtumien jono $(A_{n_\ell, k_\ell} : \ell \in \mathbb{N}) \subseteq \mathcal{F}_1$ ja $(B_{n_\ell, k_\ell} : \ell \in \mathbb{N}) \subseteq \mathcal{F}_2$ jolla

$$n_\ell \uparrow \infty, \quad A_{n_\ell, k_\ell} \supseteq A_{n_{\ell+1}, k_{\ell+1}} \quad \text{ja} \quad B_{n_\ell, k_\ell} \supseteq B_{n_{\ell+1}, k_{\ell+1}} \quad \forall \ell \in \mathbb{N},$$

ja

$$\omega' \in \bigcap_{\ell \in \mathbb{N}} A_{n_\ell, k_\ell} \neq \emptyset \quad \text{ja} \quad P_2(B_{n_\ell, k_\ell}) > \eta > 0.$$

jollekin η :lle. Koska P_2 on σ -additiivinen tästä seuraa

$$\bigcap_{n \in \mathbb{N}} B_{n_\ell, k_\ell} \neq \emptyset$$

ja siksi

$$\bigcap_{n \in \mathbb{N}} C_n \supseteq \left(\bigcap_{\ell \in \mathbb{N}} A_{n_\ell, k_\ell} \times B_{n_\ell, k_\ell} \right) \neq \emptyset$$

joka on ristiriidassa oletuksen $\mathbf{1}_{C_n}(\omega) \downarrow 0$ kanssa.

Tästä seuraa että $\forall \varepsilon > 0$

$$D_{n,\varepsilon} := \{\omega' \in \Omega_1 : f_n(\omega') > \varepsilon\} \downarrow \emptyset.$$

jossa D_n on yhdiste joistakin A_{nk} joukoista. Koska P_1 on σ -additiivinen, ja $D_{n,\varepsilon} \downarrow \emptyset$, seuraa $P_1(D_{n,\varepsilon}) \downarrow 0$ kun $n \uparrow \infty$.

Tästä seuraa $\forall \varepsilon > 0$,

$$\begin{aligned} P^{(0)}(C_n) &= \sum_{k=1}^{m_n} P_1(A_{nk}) \times P_2(B_{nk}) \\ &\leq (P_1(D_{n,\varepsilon})P_2(\Omega_2) + P_1(\Omega_1)\varepsilon) \downarrow \varepsilon, \quad \text{kun } n \uparrow \infty \end{aligned}$$

eli $P^{(0)}(C_n) \downarrow 0 \quad \square$

Esimerkki Yleinen Todennäköisyysmitta (\mathbb{R}^d)-avaruudessa Voidaan osoittaa (harjoitustehtävä) että

$$\mathcal{B}(\mathbb{R}^d) = \mathcal{B}(\mathbb{R})^{\otimes d} := \underbrace{\mathcal{B}(\mathbb{R}) \otimes \mathcal{B}(\mathbb{R}) \otimes \cdots \otimes \mathcal{B}(\mathbb{R})}_{d\text{-kertaa}}$$

Kun $s = (s_1, \dots, s_d), t = (t_1, \dots, t_d) \in (\mathbb{R} \cup \{\pm\infty\})^d$, merkitään

$$s \leq t \iff s_i \leq t_i, \quad i = 1, \dots, d, \quad s < t \iff s_i < t_i, \quad i = 1, \dots, d,$$

$$(s, t] = \{x \in \mathbb{R}^d : s < x \leq t\} = (s_1, x_1] \times \cdots \times (s_d, t_d]$$

Kun $d > 1$, järjestys-relaatio \leq ei ole täydellinen, eivät kaikki parit $s, t \in \mathbb{R}^d$ ovat verrattavissa.

Voidaan osoittaa että $\sigma((-\infty, q] : q \in \mathbb{Q}^d) = \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$ (harjoitustehtävä).

Olkoon P todennäköisyys $(\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$:ssa.

Määritellään kertymäfunktio

$$F(t) = P((-\infty, t]) = P(\{x \in \mathbb{R}^d : x_i \leq t_i, \quad i = 1, \dots, d\}), \quad t \in \mathbb{R}^d$$

Seuraa että

1. $F(t)$ on ei vähenevä \leq osittais-järjestyksen suhteen,
2. $F(t)$ on oikealta jatkuva, eli kun $t_n \downarrow t$, $F(t_n) \downarrow F(t)$,
3. $F(-\infty) := \lim_{t \downarrow -\infty} F(t) = 0$ ja $F(+\infty) := \lim_{t \uparrow +\infty} F(t) = 1$.

Toisinpäin, jos funktio $F : \mathbb{R}^d \rightarrow [0, 1]$ toteuttaa (1), (2), (3), On olemassa todennäköisyysmitta P $(\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$:ssa jolla $F(t) = P((-\infty, t]) \forall t \in \mathbb{R}^d$. Lauseen 1.1 todistus yleistyy suoraan äärellis-ulotteiseen tilanteeseen.

Esimerkki 1.2.1. Jos P_1, \dots, P_d ovat todennäköisyysmittoja $(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ avaruudessa, ja $F_1(t_1), \dots, F_d(t_d)$ niiden kertymäfunktio, on olemassa tulotodennäköisyys $\mathbb{P} = (P_1 \otimes P_2 \otimes \cdots \otimes P_d)$ $(\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$ avaruudessa, jolla on kertymäfunktio

$$\mathbb{F}(t) := F_1(t_1)F_2(t_2) \dots F_d(t_d), \quad t \in \mathbb{R}^d$$

ja jos $B_1, \dots, B_d \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$,

$$\mathbb{P}(B_1 \times \cdots \times B_d) = P_1(B_1) \times \cdots \times P_d(B_d)$$

Luku 2

Todennäköisyys äärettömissä tulo-avaruuksissa ja Kolmogorovin laajennuslause

Jatkossa työskentelemme todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}, P) joka on tarpeeksi rikas sisältämään P -riippumattomien satunnaismuuttujien jonoja $(X_n(\omega) : n \in \mathbb{N})$. Haluamme varmistaa ensin että selläinen on olemassa.

Vaikka tässä kurssissa todennäköisyysmittojen jonon tulomitan olemassaolo tuloavaruudessa riittäisi meille hyvin pitkälle, todistamme samantien Kolmogorovin laajennuslauseetta, joka koskee mielivaltaisia tuloavaruuksia, eikä rajoitu tulomittoihin. Todistuksessa ei käytetä muuta kun Caratheodoryn laajennuslauseetta ja pientä kompaktisuuden argumenttia.

Määritelmä 2.0.1. *Todennäköisyysavaruudella (Ω, \mathcal{F}) satunnaisprosessi on satunnaismuuttujien perhe $(X_t : t \in \mathbb{T})$ jossa \mathbb{T} on mielivaltainen indeksijoukko, ja $X_t(\omega) \in \mathbb{R}^d$.*

Esimerkiksi $\mathbb{T} = \mathbb{N}, \mathbb{R}^+, \mathbb{Q}^+, \mathbb{Z}, \mathbb{R}, \mathbb{Q}$ voidaan tulkita aikaparametriksi, joka voi olla diskreetti tai jatkuva.

Määritelmä 2.0.2. *Äärellisulotteisten todennäköisyysmittojen perhe \mathbb{R} :ssa on*

$$\left(P_{t_1, \dots, t_n} : \mathcal{B}(\mathbb{R}^n) \rightarrow [0, 1], \quad n \in \mathbb{N}, t_1, \dots, t_n \in \mathbb{T} \right)$$

46 LUKU 2. TODENNÄKÖISYYS ÄÄRETTÖMISSÄ TULO-AVARUUKSISSA JA KOLMO

on yhteensopiva, jos

1.

$$P_{t_1, \dots, t_n}(A_1 \times \dots \times A_n) = P_{t_{\pi(1)}, \dots, t_{\pi(n)}}(A_{t_{\pi(1)}} \times \dots \times A_{t_{\pi(n)}})$$

$$\forall n \in \mathbb{N}, A_1, \dots, A_n \in \mathcal{B}(\mathbb{R}), t_1, \dots, t_n \in \mathbb{T}, \quad \forall \text{permutaatiolle } \pi$$

2.

$$P_{t_1, \dots, t_n}(A_1 \times \dots \times A_n) = P_{t_1, \dots, t_n, t_{n+1}}(A_1 \times \dots \times A_n \times \mathbb{R})$$

Korostamme että seuraavassa lauseessa indeksijoukko \mathbb{T} on mielivaltainen.

Teoreema 2.0.1. (Daniell-Kolmogorov, 1933) Olkoon

$$\left(P_t : t \in \bigcup_{n=1}^{\infty} \mathbb{T}^n \right)$$

yhteensopiva perhe äärellisulotteisista todennäköisyysjakaumoista \mathbb{R} :ssa, indeksijoukolla \mathbb{T} .

On olemassa yksikäsitteinen todennäköisyysmitta \mathbb{P} tuloavaruudella $\Omega = \mathbb{R}^{\mathbb{T}}$ varustettuna tulo-topologian virittämällä sylinterien σ -algebralla $\sigma(\mathcal{C})$, jolla $\forall n \in \mathbb{N}, t_1, \dots, t_n \in \mathbb{T}, B_n \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^n)$,

$$\mathbb{P} \left(\left\{ \omega \in \mathbb{R}^{\mathbb{T}} : (\omega_{t_1}, \dots, \omega_{t_n}) \in B_n \right\} \right) = P_{t_1, \dots, t_n}(B_n) \quad (2.0.1)$$

Todistus

Tuloavaruuden $\Omega = \mathbb{R}^{\mathbb{T}}$ jäsenet ovat kuvaukset $t \mapsto \omega_t \in \mathbb{R}$.

Määritellään algebra \mathcal{C} joka koostuu sylintereistä

$$C = \left\{ \omega \in \mathbb{R}^{\mathbb{T}} : (\omega_{t_1}, \dots, \omega_{t_n}) \in B_n \right\}$$

jossa $n \in \mathbb{N}, t_1, \dots, t_n \in \mathbb{T}, B_n \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^n)$.

Kaava (2.0.1) määrittelee kuvauksen $\mathbb{P}_0 : \mathcal{C} \rightarrow [0, 1]$.

Yhteensopivuuden oletuksesta seuraa että $\mathbb{P}_0(C)$ on hyvin määritelty, siis ei riipu sylinterin C :n esityksestä.

Koska kahdelle sylinterille löytyy esityksiä yhteisellä indeksijoukolla, ja koska äärellis-ulotteiset jakaumat ovat todennäköisyydet, ei ole vaikea osoittaa että kuvaus $\mathbb{P}_0 : \mathcal{C} \rightarrow [0, 1]$ on äärellisesti additiivinen. (harjoitus tehtävä).

Kun osoitamme että \mathbb{P}_0 on myös σ -additiivinen \mathcal{C} algebrassa, Charatheodoryn laajennuslause astuu voimaan ja \mathbb{P}_0 voidaan laajentaa yksikäsitteisesti σ -additiiviseksi todennäköisyysmitaksi σ -algebralle $\sigma(\mathcal{C})$.

Eli jää osoitettavaksi väite:

jos $\{C_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{C}$ on sylinterien jono jolla

$$C_n \supseteq C_{n+1} \forall n, \text{ ja } \bigcap_{n \in \mathbb{N}} C_n = \emptyset,$$

seuraa $\lim_{n \rightarrow \infty} \mathbb{P}_0(C_n) = 0$.

Vastaoletuksen kautta, oletamme että on olemassa cylinterien jono $\{C_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{C}$ jolla $C_n \supseteq C_{n+1}$ ja $\mathbb{P}_0(C_n) \geq \varepsilon \forall n$ jollekin $\varepsilon > 0$, näytämme että $\bigcap_{n \in \mathbb{N}} C_n \neq \emptyset$.

Valitsemalla sopivasti sylinterien esityksiä ja mahdollisesti toistaamalla sylintereita jonossa, voidaan aina rakentaa indeksijonoa $(t_n) \subseteq \mathbb{T}$ ja sylinterijono $\{D_n : n \in \mathbb{N}\}$ jolla on esitys

$$D_n = \left\{ \omega \in \mathbb{R}^{\mathbb{T}} : (\omega_{t_1}, \dots, \omega_{t_n}) \in A_n \right\}$$

jossa $D_n \supseteq D_{n+1} \forall n$, $A_n \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^n)$, $A_n \times \mathbb{R} \supseteq A_{n+1} \forall n$, ja kaikille $m \in \mathbb{N}$ on olemassa n jolla $D_n = C_m$.

Seuraa että $\mathbb{P}_0(D_n) \geq \varepsilon > 0 \forall n$ ja

$$\bigcap_{n \in \mathbb{N}} C_n = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} D_n.$$

Koska P_{t_1, \dots, t_n} on todennäköisyysmitta \mathbb{R}^n :ssa ja siksi σ -additiivinen, ja A_n on Borel mitallinen, on olemassa suljettu joukko $F_n \subseteq A_n$ jolla

$$P_{t_1, \dots, t_n}(A_n \setminus F_n) < \varepsilon 2^{-n}.$$

48LUKU 2. TODENNÄKÖISYYS ÄÄRETTÖMISSÄ TULO-AVARUUKSISSA JA KOLMO

Valitsemalla tarpeeksi suurta origo-keskeistä palloa $B(0, r_n)$, löytyy myös kompakti $K_n = (F_n \cap B(0, r_n)) \subseteq A_n$ jolla edelleen

$$P_{t_1, \dots, t_n}(A_n \setminus K_n) = \mathbb{P}_0(D_n \setminus G_n) < \varepsilon 2^{-n}$$

jossa

$$G_n := \left\{ \omega \in \mathbb{R}^{\mathbb{T}} : (\omega_{t_1}, \dots, \omega_{t_n}) \in K_n \right\}$$

Koska nämä eivät välttämättä muodosta vähenevää jonoa, otamme leikkaukset

$$G'_n = \bigcap_{m=1}^n G_m = \left\{ \omega \in \mathbb{R}^{\mathbb{T}} : (\omega_{t_1}, \dots, \omega_{t_n}) \in K'_n \right\}$$

jossa

$$K'_n := K_n \cap (K_{n-1} \times \mathbb{R}) \cap \dots \cap (K_1 \times \mathbb{R}^{n-1}) \subseteq K_n$$

ovat kompakteja (kompakti ja suljetun joukon leikkaus on kompakti).

Seuraa $G'_n \supseteq G'_{n+1}$, ja $(K'_n \times \mathbb{R}) \supseteq K'_{n+1}$.

Tästä seuraa

$$\begin{aligned} P_{t_1, \dots, t_n}(K'_n) &= \mathbb{P}_0(G'_n) = \mathbb{P}_0(D_n) - \mathbb{P}_0(D_n \setminus G'_n) = \\ &= P_{t_1, \dots, t_n}(A_n) - P_{t_1, \dots, t_n}\left(\bigcup_{m=1}^n A_n \setminus (K_m \times \mathbb{R}^{(n-m)})\right) \\ &\geq P_{t_1, \dots, t_n}(A_n) - P_{t_1, \dots, t_n}\left(\bigcup_{m=1}^n (A_m \setminus K_m) \times \mathbb{R}^{(n-m)}\right) \\ &\quad (\text{koska } A_m \times \mathbb{R}^{(n-m)} \supseteq A_n \text{ kun } n \geq m) \\ &= \mathbb{P}_0(D_n) - \mathbb{P}_0\left(\bigcup_{m=1}^n D_m \setminus G_m\right) \\ &\geq \mathbb{P}_0(D_n) - \sum_{m=1}^n \mathbb{P}_0(D_m \setminus G_m) \geq \varepsilon - \sum_{m=1}^n \varepsilon 2^{-m} > \frac{\varepsilon}{2} > 0 \end{aligned}$$

jossa käytettiin vastaoletusta $\mathbb{P}_0(D_n) > \varepsilon$.

Siksi $\forall n, \exists (x_1^{(n)} \dots, x_n^{(n)}) \in K'_n \neq \emptyset$.

Koska jono G'_n ei kasva, seuraa että $(x_1^{(n)}) \subseteq K'_1 \subseteq \mathbb{R}, \forall n \in \mathbb{N}$.

Koska K'_1 on kompakti, Heine-Borelin lauseesta seuraa että on olemassa suppeneva alijono $x_1^{(n_i)} \rightarrow x_1^* \in K'_1$.

Myös alijono $(x_1^{(n_i)}, x_2^{(n_i)}) \subseteq K'_2$, ja on olemassa suppeneva alijonon alijono jolla on raja $(x_1^*, x_2^*) \in K'_2 \subseteq \mathbb{R}^2$.

Induktiivisesti löytyy jono (x_n^*) jolla $(x_1^*, \dots, x_n^*) \in K'_n \subseteq \mathbb{R}^n \forall n$.

Joukot

$$D^* = \left\{ \omega \in \mathbb{R}^{\mathbb{T}} : \omega_{t_n} = x_n^* \quad \forall n \right\} \subseteq \bigcap_{n \in \mathbb{N}} G'_n \subseteq \bigcap_{n \in \mathbb{N}} D_n = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} C_n$$

eivät ole tyhjiä \square

Huomautus 2.0.1. Näytämme pian että Kolmogoroviin lause on voimassa ei pelkästään kun $\Omega_t = \mathbb{R}, \forall t \in \mathbb{T}$ mutta myös hyvin yleisemmilla Borelin todennäköisyysavaruuksilla.

50 LUKU 2. TODENNÄKÖISYYS ÄÄRETTÖMISSÄ TULO-AVARUUKSISSA JA KOLMO

Luku 3

Satunnaismuuttujat

Olkoon $X : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (E, \mathcal{E})$ kuvaus todennäköisyysavaruuksien välillä. X on mitallinen kuvaus, todennäköisyyskielellä *satunnaismuuttuja*, kun $\forall B \in \mathcal{E}$, mitallisen joukon alkukuva on mitallinen, eli

$$X^{-1}(B) := \{\omega : X(\omega) \in B\} \in \mathcal{F}$$

Tyypillisesti $(E, \mathcal{E}) = (\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$ jossa $\mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$ on avoimien joukkojen viritämä σ -algebra. Kun X on satunnaismuuttuja, merkitään $X \in L^0(\Omega, \mathcal{F})$ tai lyhyesti $X \in \mathcal{F}$ silloin kun kontekstista on selvää että X on funktio ω :sta eikä Ω :n alijuokko.

Huomautus 3.0.2. Huomataan samankaltaisuus jatkuvan funktion määrittelyn kanssa: olkoon (S_i, \mathcal{S}_i) , $i = 1, 2$ topologiset avaruudet, jossa S_i ovat avointen joukkojen kokoelmat. Sanotaan että $f : (S_1, \mathcal{S}_1) \rightarrow (S_2, \mathcal{S}_2)$ on jatkuva jos ja vain jos kaikille avoimille $U \in \mathcal{S}_2$ pätee

$$f^{-1}(U) = \{x \in S_1 : f(x) \in U\} \in \mathcal{S}_1,$$

eli se on avoin S_1 :n topologiassa.

Lemma 3.0.1. Jos $X : \Omega \mapsto E$ on kuvaus, (ei välttämättä mitallinen)

$$X^{-1}\left(\bigcup_{i \in \mathcal{I}} A_i\right) = \bigcup_{i \in \mathcal{I}} X^{-1}(A_i), \quad X^{-1}(A^c) = \left(X^{-1}(A)\right)^c$$

jossa $A, A_i \subseteq E$ ja \mathcal{I} on mielivaltainen indeksi joukko (ei välttämättä numeroituva).

Lemma 3.0.2. *Olkoon $X : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (E, \mathcal{E})$ ja $Y : (E, \mathcal{E}) \rightarrow (G, \mathcal{G})$ mitalliset kuvaukset todennäköisyysavaruuksien välissä. Silloin kuvaus $(Y \circ X)(\omega) := Y(X(\omega))$ on mitallinen (Ω, \mathcal{F}) ja (G, \mathcal{G}) välissä.*

Tod. Kun $B \in \mathcal{G}$,

$$(Y \circ X)^{-1}(G) = \{\omega : Y(X(\omega)) \in G\} = \{\omega : X(\omega) \in Y^{-1}(G)\} \in \mathcal{F}$$

koska $Y^{-1}(G) \in \mathcal{E}$ ja X on $(\mathcal{F}, \mathcal{E})$ -mitallinen.

Määritelmä 3.0.3. *Olkoon $X : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (E, \mathcal{E})$ satunnaismuuttuja. Määritellään*

$$\sigma(X) = \{ X^{-1}(B) : B \in \mathcal{E} \} \subseteq \mathcal{F},$$

joka on satunnaismuuttujan X :n virittämä σ -algebra. Se on pienin σ -algebra Ω avaruudella jonka suhteen X on mitallinen.

Lemma 3.0.3. *Olkoon $f : E \rightarrow H$, jatkuva funktio topologisten avaruuksien välissä, ja olkoon $\mathcal{B}(E)$ ja $\mathcal{B}(H)$ vastaavat avointen joukkojen virittämiä Borelin σ -algebrat. Silloin*

- *kuvaus $f : (E, \mathcal{B}(E)) \rightarrow (H, \mathcal{B}(H))$ on mitallinen.*
- *$f^{-1}(\mathcal{B}(H)) = \sigma\{f^{-1}(U) : U \subseteq H \text{ avoin}\}$, on pienin E :n σ -algebra jonka suhteen f on Borel-mitallinen.*

Tod. Kun $U \subseteq H$ avoin, koska f on jatkuva, seuraa että $f^{-1}(U) \subseteq E$ on avoin E :ssä. Tästä seuraa

$$\sigma\{f^{-1}(U) : U \subseteq H \text{ avoin}\} \subseteq \mathcal{B}(E)$$

Joukko perheet

$$\{U \subseteq H \text{ avoin}\} \text{ ja } \{f^{-1}(U) : U \subseteq H \text{ avoin}\}$$

ovat π -luokkia koska avointen joukkojen äärellinen leikkaus on avoin.

Kun \mathcal{D} on d -luokka H :ssa,

$$f^{-1}(\mathcal{D}) = \{f^{-1}(D) : D \in \mathcal{D}\}$$

on d -luokka E :ssa:

$$E = f^{-1}(H) \in f^{-1}(\mathcal{D}) \text{ koska } H \in \mathcal{D}.$$

Jos $A_1 = f^{-1}(B_1) \subseteq f^{-1}(B_2)$ jossa $B_i \in \mathcal{D}$, seuraa $B_1 \subseteq B_2$ ja $B_2 \setminus B_1 \in \mathcal{D}$ josta seuraa $f^{-1}(B_2) \setminus f^{-1}(B_1) = f^{-1}(B_2 \setminus B_1) \in f^{-1}(\mathcal{D})$.

Jos $A_n = f^{-1}(B_n) \in f^{-1}(\mathcal{D})$ ja $A_n \uparrow A = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A_n$,

$$\text{seuraa } A = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} f^{-1}(B_n) = f^{-1}\left(\bigcup_{n \in \mathbb{N}} B_n\right) \in f^{-1}(\mathcal{D}).$$

Koska $\mathcal{B}(H)$ on pienin d -luokka joka sisältää π -luokan $\{U \subseteq H \text{ avoin}\}$,

$f^{-1}(\mathcal{B}(H))$ on pienin d -luokka joka sisältää π -luokan

$\{f^{-1}(U) : U \subseteq H \text{ avoin}\}$, ja lemmasta 1.1.3 seuraa

$$f^{-1}(\mathcal{B}(H)) = \sigma\{f^{-1}(U) : U \subseteq H \text{ avoin}\} \square$$

Seuraus 3.0.1. Olkoon $X_i : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$, $i = 1, \dots, d$ \mathbb{R} -arvoisia satunnaismuuttuja. Silloin vektori-arvoinen kuvaus $X : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$ jolla $X(\omega) = (X_1(\omega), \dots, X_d(\omega))$ on \mathbb{R}^d -arvoinen satunnaismuuttuja.

Tod. Kun $B_i \subseteq \mathcal{B}(\mathbb{R})$, $i = 1, \dots, d$,

$$\{\omega : X(\omega) \in B_1 \times \dots \times B_d\} = \left(\bigcap_{i=1}^d \{\omega : X_i(\omega) \in B_i\} \right) \in \mathcal{F}$$

ja väite seuraa koska $\sigma(B_1 \times \dots \times B_d : B_i \in \mathcal{B}(\mathbb{R})) = \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$.

Tarkemmin, olkoon

$$X^{-1}(B) = \{\omega : X_1(\omega), \dots, X_d(\omega) \in B\}, \quad B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^d),$$

$$\mathcal{D} = \{B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^d) : X^{-1}(B) \in \mathcal{F}\} \supseteq \mathcal{I} = \{B_1 \times B_2 \times \dots \times B_d : B_i \in \mathcal{B}(\mathbb{R})\}$$

jossa \mathcal{D} on σ -algebra ja \mathcal{I} on π -luokka. Mutta $\sigma(\mathcal{I}) = \mathcal{B}(\mathbb{R})^{\otimes d} = \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$, josta seuraa että $X^{-1}(B) \in \mathcal{F}$, $\forall B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$. \square

Seuraus 3.0.2. Olkoon $X : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$ satunnaisvektori ja $f : X(\Omega) \subseteq \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ jatkuva kuvaus.

Seuraa että kuvaus $\omega \mapsto (f \circ X)(\omega) = f(X(\omega))$ on satunnaismuuttuja.

Erityisesti jos (X, Y) ovat s.m. $\rightarrow (X + Y)$, (XY) ovat s.m.

Jos $Y(\omega) \neq 0 \quad \forall \omega$, seuraa että (X/Y) on satunnaismuuttuja.

Lemma 3.0.4. Jos $\{X_n : n \in \mathbb{N}\}$ on s.m. jono todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}) ,

$$X^*(\omega) := \sup_{n \in \mathbb{N}} X_n(\omega)$$

on satunnaismuuttuja.

Tod. $\mathcal{D} = \{B \subseteq \mathcal{B}(\mathbb{R}) : (X^*)^{-1}(B) \in \mathcal{F}\}$ on σ -algebra. Koska jokaiselle $t \in \mathbb{R}$

$$(X^*)^{-1}((-\infty, t]) := \{\omega : X^*(\omega) \leq t\} = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} \{\omega : X_n(\omega) \leq t\} \in \mathcal{F},$$

seuraa että $(-\infty, t] \in \mathcal{D}$. Koska nämät muodostuvat π -luokan, seuraa että \mathcal{D} on niiden virittämä σ -algebra, joka on $\mathcal{B}(\mathbb{R})$.

Seuraus 3.0.3. Myös $\liminf_n X_n(\omega)$ ja $\limsup_n X_n(\omega)$ ovat satunnaismuuttujia (harjoitustehtävä).

Seuraava lause on Dynkinin lemmän (1.1.3) vastine satunnaismuuttujille:

Teoreema 3.0.2. (Monotonisen luokan lause) Olkoon \mathcal{C} kokoelma rajoitetuista funktioista $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$. Sanotaan että \mathcal{C} on **monotoninen luokka** kun

1. \mathcal{C} on vektoriavaruus.
2. vakio funktio $\mathbf{1} \in \mathcal{C}$.
3. \mathcal{C} on suljettu monotonisen rajankäynnin suhteen:

kaikille jonoille $\{X_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{C}$ joilla

$$0 \leq X_n(\omega) \leq X_{n+1}(\omega) \quad \forall \omega \in \Omega, n \in \mathbb{N}, \text{ ja}$$

$$X(\omega) := \lim_{n \uparrow \infty} X_n(\omega) \text{ on rajoitettu funktio,}$$

seuraa $X \in \mathcal{C}$.

Kun $\mathcal{C} \supseteq \{ \mathbf{1}_A(\omega) : A \in \mathcal{I} \}$ jossa $\mathcal{I} \subseteq 2^\Omega$ on π -luokka (suljettu joukkojen äärellisen leikkauksen suhteen), seuraa

$$\mathcal{C} \supseteq \left\{ \text{rajoitetut ja } (\Omega, \sigma(\mathcal{I})) \longrightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R})) \text{ mitalliset funktiot} \right\}$$

Tod. Olkoon $\mathcal{D} = \{A \subseteq \Omega : \mathbf{1}_A \in \mathcal{C}\}$.

Seuraa monotonisen luokan määritelmästä että \mathcal{D} on d -luokka joka sisältää π -luokan \mathcal{I} , ja Dynkinin lemmasta (1.1.3) seuraa myös $\mathcal{D} \supseteq \sigma(\mathcal{I})$.

Olkoon $X(\omega)$ $\sigma(\mathcal{I})$ -mitallinen satunnaismuuttuja jolla

$$0 \leq X(\omega) \leq K < \infty \quad \forall \omega \in \Omega.$$

Määritellään kuvausten jono

$$X^{(n)}(\omega) := \sum_{\ell=0}^{n-1} \frac{K\ell}{n} \mathbf{1} \left\{ X(\omega) \in \left(\frac{K\ell}{n}, \frac{K(\ell+1)}{n} \right] \right\}, \quad n \in \mathbb{N}.$$

Koska \mathcal{C} on vektoriavaruus, seuraa $\{X^{(n)}\} \subseteq \mathcal{C}$, ja koska

$$0 \leq X^{(n)}(\omega) \uparrow X(\omega) \quad \forall \omega \in \Omega$$

jossa oletetusti $X(\omega)$ on rajoitettu, seuraa että $X(\omega) \in \mathcal{C}$ \square

Seuraava lause on esimerkki monotonisen luokan lauseen käytöstä.

Teorema 3.0.3. *Olkoon kuvaus $Y : (\Omega, \mathcal{F}, P) \rightarrow (S, \mathcal{S})$ S -arvoinen satunnaismuuttuja, esimerkiksi $(S, \mathcal{S}) = (\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$.*

Olkoon

$$\sigma(Y) := \{ Y^{-1}(A) : A \in \mathcal{S} \}.$$

- $\sigma(Y)$ on pienin Ω :n σ -algebra jonka suhteen $Y(\omega)$ on mitallinen.
- $\sigma(Y)$ kutsutaan satunnaismuuttujan Y virittämän σ -algebraksi.
- Toinen satunnaismuuttuja $X : (\Omega, \mathcal{F}, P) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ on $\sigma(Y)$ -mitallinen jos ja vain jos on olemassa Borel-mitallinen kuvaus $f : (S, \mathcal{S}) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ jolla $X(\omega) = f(Y(\omega))$.

Todistus \Leftarrow implikaatio on jo osoitettu (lemma 3.0.2).

Olkoon

$$\mathcal{C} = \{ f(Y(\omega)) : f \text{ on Borel-mitallinen ja } |f(Y(\omega))| \text{ on rajoitettu} \}$$

Selvästi \mathcal{C} on vektori avaruus joka sisältää vakiot. Olkoon $\{f_n\}_{n \in \mathbb{N}}$ Borel-mitallisten funktioiden jono jolla

$$0 \leq f_n(Y(\omega)) \leq f_{n+1}(Y(\omega)) \leq K < \infty \quad \forall n \in \mathbb{N}, \omega \in \Omega,$$

ja $f(y) := \limsup_n f_n(y) \quad \forall y \in S$. Seuraa että $f : (S, \mathcal{S}) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ on mitallinen, ja

$$0 \leq f_n(Y(\omega)) \uparrow f(Y(\omega)) \leq K < \infty \quad \text{kun } n \uparrow \infty.$$

Siis \mathcal{C} on monotoninen luokka. Koska $\mathbf{1}_A(Y(\omega)) \in \mathcal{C} \quad \forall A \in \mathcal{S}$, ja

$$\sigma(Y) = \{Y^{-1}(A) : A \in \mathcal{S}\}$$

seuraa että \mathcal{C} sisältää kaikki $\sigma(Y)$ -mitallisia ja rajoitettuja \mathbb{R} -arvoisia satunnaismuuttujia.

Yleisemmin, jos $X(\omega)$ on $\sigma(Y)$ -mitallinen \mathbb{R} -arvoinen satunnaismuuttuja joka ei ole rajoitettu, koska $\arctan(x)$ on jatkuva bijektio \mathbb{R} ja avoimen välin $(-\pi/2, \pi/2)$ välissä, satunnaismuuttuja $\arctan(X(\omega))$ on rajoitettu ja $\sigma(Y)$ -mitallinen.

Tästä seuraa että $\arctan(X(\omega)) = f(Y(\omega))$ jollekin Borel-mitalliselle funktiolle $f(y)$, ja silloin $X(\omega) = \tan(f(Y(\omega)))$ jossa $\tan(f(y))$ on myös Borel mitallinen funktio \square

3.1 Satunnaismuuttujan jakauma

Määritelmä 3.1.1. *Olkoon $X : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (S, \mathcal{S})$ satunnaismuuttuja, esimerkiksi $(S, \mathcal{S}) = (\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$, ja olkoon P todennäköisyys (Ω, \mathcal{F}) -avaruudessa.*

Todennäköisyysmitta

$$P_X(B) := (P \circ X^{-1})(B) = P(\{\omega : X(\omega) \in B\}), \quad \forall B \in \mathcal{S}$$

kutsutaan satunnaismuuttujan X jakaumaksi tai pushforward-todennäköisyysmitaksi.

Esimerkki 3.1.1. *Osoita että P_X on todennäköisyys (S, \mathcal{S}) avaruudessa.*

Luku 4

Odotusarvo ja Integraali

Määritelmä 4.0.2. Satunnaismuuttuja $X(\omega) : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ on yksinkertainen jos

$$X(\omega) = \sum_{k=1}^n x_k \mathbf{1}_{A_k}(\omega), \quad n \in \mathbb{N}, x_k \in \mathbb{R}, A_k \in \mathcal{F}$$

Merkitään $X \in \mathcal{YF}$. Jos $X(\omega) \geq 0 \forall \omega$, merkitään $X \in \mathcal{YF}^+$. Tällöin määritellään satunnaismuuttujan odotusarvo todennäköisyyksimitan P :n suhteen

$$E_P(X) = \sum_{k=1}^n x_k P(A_k)$$

De Finettin mukaan, odotusarvo $E_P(X)$ tulkitaan vedonlyönnin sopimuksen X :n johdonmukaiseksi hinnaksi, hinta-systeemissä jossa indikaattorit $\mathbf{1}_{A_k}$ saavat hintoja $P(A_k)$, $k = 1, \dots, n$.

Harjoitustehtäväkasi tarkistetaan että yksinkertaisen satunnaismuuttujan odotusarvo ei riipu sattunnaismuuttujan esityksestä ja

$$E_P(X) = \sum_{x \in \mathbb{R}} x P(\{\omega : X(\omega) = x\})$$

Lemma 4.0.1. Olkoon $X, Y \in \mathcal{YF}$, $\lambda \in \mathbb{R}$ (deterministinen).

- Kun $X(\omega) \geq 0, \forall \omega$, seuraa että $E_P(X) \geq 0$ (positiivisuus).
- $E_P(X + Y) = E_P(X) + E_P(Y)$ ja $E_P(\lambda X) = \lambda E_P(X)$.

Odotusarvon määritelmä yleistetään seuraavalla tavalla:

Määritelmä 4.0.3. *Olkoon $X(\omega) \geq 0 \forall \omega$. Silloin*

$$E_P(X) := \sup\{E_P(Y) : Y \in \mathcal{YF}^+, 0 \leq Y(\omega) \leq X(\omega) \quad \forall \omega\}$$

Yleisemmin käytämme hajotelmaa $X(\omega) = X^+(\omega) - X^-(\omega)$, jossa satunnaismuuttujat $X^+(\omega) := \max\{X(\omega), 0\}$, $X^-(\omega) := \max\{-X(\omega), 0\}$ ovat ei-negatiivisia, ja määritellään

$$\int_{\Omega} X(\omega)P(d\omega) := E_P(X) := E_P(X^+) - E_P(X^-).$$

Kun $E_P(|X|) = E_P(X^+) + E_P(X^-) < +\infty$, sanomme että X on integroitava satunnaismuuttuja ja merkitsemme $X \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$.

Kun $E_P(X^+) = \infty$ ja $E_P(X^-) < +\infty$, määritellään $E_P(X) = +\infty$, vastavasti jos $E_P(X^+) < \infty$ ja $E_P(X^-) = \infty$, $E_P(X) := -\infty$.

Kun $E_P(X^+) = E_P(X^-) = \infty$ odotusarvo $E_P(X)$ ei ole määriteltävissä.

Lemma 4.0.2. *Olkoon $X(\omega) \geq 0, \forall \omega$.*

Kun $E_P(X) = 0$, seuraa $P(\{\omega : X(\omega) > 0\}) = 0$.

Tod. Olkoon $Y_n(\omega) = n^{-1}\mathbf{1}(X(\omega) > n^{-1})$. Silloin

$$Y_n \in \mathcal{YF}^+ \text{ ja } Y_n(\omega) \leq X(\omega), \quad \forall \omega.$$

Odotusarvon määritelmästä seuraa

$$0 = E_P(X) \geq E_P(Y_n) = n^{-1}P(X(\omega) > n^{-1}) \geq 0, \quad \text{ja}$$

$$P(X(\omega) > 0) = P\left(\bigcup_n \{\omega : X(\omega) > n^{-1}\}\right) \leq \sum_n P(X(\omega) > n^{-1}) = 0 \quad \square$$

Lemma 4.0.3. *Kun $X(\omega)$ ja $B \in \mathcal{F}$ jolla $P(B) = 1$, seuraa*

$$E_P(X\mathbf{1}_B) = E_P(X).$$

Tod. Väite on tosi kun $X(\omega) = \mathbf{1}_A(\omega)$,

$$E_P(\mathbf{1}_A\mathbf{1}_B) = E_P(\mathbf{1}_{A \cap B}) = P(A \cap B) = P(A) - P(A \cap B^c) = P(A),$$

koska $P(A \cap B^c) \leq P(B^c) = 1 - P(B) = 0$, ja lineaarisuudesta seuraa myös kaikille $X \in \mathcal{YF}$.

Olkoon $X(\omega) \geq 0$, ja $\{X_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{YF}^+$ jolla $0 \leq X_n(\omega) \leq X(\omega)$ ja $E_P(X_n) \uparrow E_P(X)$. Silloin koska $\mathbf{1}_B(\omega)X_n(\omega) \leq \mathbf{1}_B(\omega)X(\omega)$ ja odotusarvo on positiivinen,

$$E_P(\mathbf{1}_B X) \geq E_P(\mathbf{1}_B X_n) = E_P(X_n) \uparrow E_P(X) \geq E_P(\mathbf{1}_B X) \quad \square$$

Seuraus 4.0.1. Jos $P(\{\omega : X(\omega) = Y(\omega)\}) = 1$, eli $X(\omega) = Y(\omega)$ P -melkein varmasti, seuraa $E_P(X) = E_P(Y)$.

Riemann-Stieltjesin ja Lebesgue-Stieltjesin integraalit Olkoon $a < b \in \mathbb{R}$, $\Omega = (a, b]$, $\mathcal{F} = \mathcal{B}((a, b])$,

$P = P_G$ jossa $G : (a, b] \rightarrow [0, 1]$ on ei-vähenevä oikealta jatkuva funktio jolla $G(a) = 0$, $G(b) = 1$.

Caratheodoryn lauseen mukaan on olemassa yksikäsitteinen todennäköisyysmitta $P_G : \mathcal{B}((a, b]) \rightarrow [0, 1]$ jolle $P_G((a, x]) = G(x) - G(a)$.

Olkoon $H : (a, b] \rightarrow \mathbb{R}^+$ ei-negatiivinen mitallinen funktio. Osoitamme että

$$E_{P_G}(H) = \int_a^b H(x)G(dx) \text{ (Lebesgue-Stieltjesin integraali)}$$

jossa oikean puolen integraali on Riemann-Stieltjesin integraalin yleistys.

Määritelmä 4.0.4. Olkoon Π välin $(a, b]$ ositus äärellisellä välipistemäärällä:

$$\Pi = (a = x_0 \leq \xi_0 \leq x_1 \leq \xi_1 \leq x_2 \leq \cdots \leq x_{N-1} \leq \xi_{N-1} \leq x_N = b), \quad n \in \mathbb{N}$$

Merkitään $\Delta(\Pi) = \max_{0 < i \leq n} (x_i - x_{i-1})$. Määritellään Riemannin Stieltjesin integraali

$$\begin{aligned} \text{(Riemann-Stieltjes)-} \int_a^b H(x)G(dx) &:= \lim_{\Delta(\Pi) \rightarrow 0} \sum_{k=1}^{N(\Pi)} H(\xi_k)(G(x_{k+1}) - G(x_k)) \\ &= \lim_{\Delta(\Pi) \rightarrow 0} \sum_{k=1}^{N(\Pi)} H(\xi_k)P_G((x_k, x_{k+1}]) = \lim_{\Delta(\Pi) \rightarrow 0} E_P(H^{(\Pi)}) \quad \text{jossa} \\ H^{(\Pi)}(u) &:= \sum_{k=1}^{N(\Pi)} H(\xi_k)\mathbf{1}_{(x_k, x_{k+1}]}(u) \end{aligned}$$

silloin kun raja-arvo on olemassa ja on yksikäsitteinen riippumatta ositusten jonon ja välipisteiden $\xi_i \in [x_i, x_{i+1}]$ välinnästä.

Lause 4.0.1. Kun $H(x)$ (palottain) jatkuva, ja $G(x)$ on ei-vähenevä, Riemann-Stieltjesin integraali $\int_a^b H(x)G(dx)$ on olemassa.

Todistus Olkoon $H : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ jatkuva funktio, ja $H^{(\Pi)}$ sen yksinkertainen approksimaatio osituksen Π :n mukaan. Määritelmään mukaan

$$\int_a^b H(y)G(dy) = \lim_{\Delta(\Pi) \rightarrow 0} \int_a^b H^{(\Pi)}(y)G(dy)$$

kun raja-arvo on olemassa eikä riippuu ositusten jonosta.

Olkoon $(\Pi_n : n \in \mathbb{N})$ $[a, b]$ välin ositusten jono joilla $\Delta(\Pi_n) \rightarrow 0$. Osituksille Π_n, Π_m pätee

$$\begin{aligned} & \left| \int_a^b H^{(\Pi_n)}(y)G(dy) - \int_a^b H^{(\Pi_m)}(y)G(dy) \right| \leq \int_a^b |H^{(\Pi_n)}(y) - H^{(\Pi_m)}(y)|G(dy) \\ & = \sum_{i=0}^{N-1} |H(\xi_i) - H(\eta_i)|(G(x_{i+1}) - G(x_i)) \end{aligned}$$

joillekin $x_0 < x_1 < \dots < x_N$ ja $|\xi_i - \eta_i| \leq (\Delta(\Pi_n) + \Delta(\Pi_m))$. Koska H on jatkuva kompaktissa $[a, b]$ se on siinä tasaisesti jatkuva, eli $\forall \varepsilon > 0$ on olemassa δ joilla kun $|\xi - \eta| \leq \delta \implies |H(\xi) - H(\eta)| < \varepsilon$.

Tästä seuraa että kun n, m ovat tarpeeksi suuria

$$\left| \int_a^b H^{(\Pi_n)}(y)G(dy) - \int_a^b H^{(\Pi_m)}(y)G(dy) \right| \leq \varepsilon \sum_{i=0}^{N-1} (G(x_{i+1}) - G(x_i)) = \varepsilon(G(b) - G(a))$$

Tästä seuraa että $\left(\int_a^b H^{\Pi_n}(y)G(dy) : n \in \mathbb{N} \right)$ on Cauchy jono joka suppenee.

Seuraa myös että jos (Π'_n) on toinen ositusten jono jolla $\Delta(\Pi'_n) \rightarrow 0$, kun määritellään jono (Π''_n) jolla $\Pi''_{2n} = \Pi_n$ ja $\Pi''_{2n+1} = \Pi'_n$, seuraa että myös $\int_a^b H^{(\Pi''_n)}(y)G(dy)$ suppenee kun $n \rightarrow \infty$, ja siksi raja-arvo ei riipu ositusten jonosta \square

Tehtävä 4.0.1. Osoita että Riemann-Stieltjesin integraali on olemassa kun funktio $H(y)$ on ei-vähenevä. Vihje: Osoita ensin että epäjatkuvuus pisteiden joukko

$$D := \left\{ y : H(y-) := \lim_{x \uparrow y} H(x) < H(y+) = \lim_{x \downarrow y} H(x) \right\}$$

on korkeintaan numeroituva. Käytä sitten hajotelma

$$H(x) = \left(H^c(x) - \sum_{y \leq x} \Delta H(y) \right) \quad \text{jossa} \quad \Delta H(y) := H(y+) - H(y-)$$

jossa näytät että $H_c(x)$ on ei-vähenevä ja jatkuva. Tämä yleistyy suoraan tapaukseen jossa $H(y) = (H^\oplus(y) - H^\ominus(y))$, $G(y) = (G^\oplus(y) - G^\ominus(y))$, jossa $H^\oplus, H^\ominus, G^\oplus, G^\ominus$, ovat ei-väheneviä.

Tehtävä 4.0.2. Osoite että jos $H(x)$ on (palottain) jatkuva ja $G(x)$ on derivoituva jatkuvalla derivaatalla $G'(x)$, Riemannin Stieltjes integraaleille pätee

$$\int_a^b H(x)G(dx) = \int_a^b H(x)G'(x)dx$$

Kun $H(x)$ on pelkästään Borel- mitallinen mutta ei palottain-jatkuva, on olemassa ositusten jonot ja välipisteiden valinnat joilla approksimaation raja ei ole olemassa, siinä tapauksessa Riemann-Stieltjes integrointitapa ei toimi.

Vuonna 1902 ranskalainen Henri Lebesgue keksi omassa väitöskirjassa uuden integrointitavan jossa funktio $y = H(x)$ integraalin approksimoidaan osittamaalla y -akselin x -akselin sijaan. Olkoon ensin H Borel-mitallinen funktio jolla $H(x) \geq 0 \forall x$. Määritellään kuvaus $\alpha^{(N)} : [0, +\infty) \rightarrow [0, +\infty)$ jossa

$$\alpha^{(N)}(y) = \begin{cases} 0 & \text{kun } 0 \leq y \leq N^{-1} \\ \left(\frac{k}{N}\right) & \text{kun } kN^{-1} < y \leq (k+1)N^{-1}, \quad k = 1, \dots, (N^2 - 1) \\ N & \text{kun } y \geq N \end{cases} \quad (4.0.1)$$

$$\text{siis } \alpha^{(N)}(y) = \sum_{k=1}^{(N^2-1)} \left(\frac{k}{N}\right) \mathbf{1}_{\left(\frac{k}{N}, \frac{k+1}{N}\right]}(y) + N \mathbf{1}_{[N, +\infty)}(y)$$

Huomataan että kuvaus $\alpha^{(N)}$ on vasemmalta jatkuva kuten indikaattori-kuvaukset $\mathbf{1}_{(a,b]}(y)$.

Approksimoidaan alhaalta satunnaismuuttuja $H(x) \geq 0$ yksinkertaisella satunnaismuuttujalla $H^{(N)}(x) := \alpha^{(N)}(H(x))$. Koska

$$0 \leq H(x) - H^{(N)}(x) \leq 1/N \quad \text{kun } 0 \leq H(x) \leq N,$$

ja $H^{(N)}(x) \leq H^{(N+1)}(x)$, seuraa että $H^{(N)}(x) \uparrow H(x)$ kun $N \uparrow \infty$.

Koska $H^{(N)}(x)$ on yksinkertainen satunnaismuuttuja, sen P_G -odotusarvo on summa

$$\begin{aligned} E_P(H^{(N)}) &= \sum_{y \in \mathbb{R}} y P_G(H^{(N)} = y) = \\ &= \sum_{k=0}^{(N^2-1)} \frac{k}{N} P_G\left(\left\{x : H(x) \in \left(\frac{k}{N}, \frac{k+1}{N}\right]\right\}\right) = \int_a^b H^{(N)}(x) G(dx) \end{aligned}$$

jossa viimeinen integraali on yksinkertaisen funktion Lebesgue-Stieltjes integraali eikä Riemannin integraali. Yksinkertainen funktio $H^{(N)}(x)$ ei ole välttämättä palottain jatkuva.

Huomataan myös että kun funktio $H(x)$ on jatkuva välissä $(a, b]$, käänteiskuva

$$H^{-1}\left(\left(\frac{k}{N}, \frac{k+1}{N}\right]\right) := \left\{x : H(x) \in \left(\frac{k}{N}, \frac{k+1}{N}\right]\right\}$$

on äärellinen yhdiste väli-joukoista, mutta näin ei tarvitse olla kun $H(x)$ on pelkästään Borel-mitallinen. Silloin y -akselin osituksen vastaa x -akselin ositus ja sen takia siinä tapauksessa Lebesgue ja Riemann integraalit yhtyvät.

Osoitamme että kun $H(x) \geq 0$ on mitallinen, raja-arvo $\lim_{N \rightarrow \infty} E_{P_G}(H^{(N)})$ on olemassa kaikille yksinkertaisten satunnaismuuttujien jonoille joilla $H^{(N)}(x) \uparrow H(x)$, ja sen arvo on

$$E_{P_G}(H) = \int_0^\infty y P_G(x : H(x) \in dy) := (\text{Lebesgue-Stieltjes})- \int_a^b H(x) G(dx),$$

approksimoivasta jonosta riippumatta.

4.1 Monotonisen konvergenssin lause.

Odotusarvon määritelmän mukaan, kun $X \in \mathcal{F}$ on olemassa jono $(X_n : n \in \mathbb{N}) \subseteq \mathcal{YF}^+$ jolla $0 \leq X_n(\omega) \leq X(\omega)$ ja $E(X_n) \rightarrow E(X)$.

Osoitamme että $E(X_n) \uparrow E(X)$ kaikille satunnaismuuttujien jonoille jolla $0 \leq X_n \uparrow X$.

Lemma 4.1.1. *Olko jono $\{a_n^k : k, n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathbb{R}$ joka on ei-vähenevä molempien indeksien (k, n) suhteen,*

$$a_{n-1}^k \leq a_n^k \leq a_{k+1}^n \quad \forall k, n \in \mathbb{N}$$

Silloin jonon raja-arvo on olemassa riippumatta rajankäynnin järjestyksestä

$$\exists a := \lim_n (\lim_k a_n^k) = \lim_k (\lim_n a_n^k), \quad a \in \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$$

Myös jokaiselle indeksijonolle $\{n(l), k(l)\}_{l \in \mathbb{N}}$ jossa $n(l), k(l) \rightarrow \infty$

$$\lim_{l \rightarrow \infty} a_{n(l)}^{k(l)} = a$$

Tod. monotonisuudesta seuraa että $\forall k$ kun $n \uparrow \infty$

$$\begin{array}{ccc} a_n^k & \uparrow & a_\infty^k \\ |\wedge & & |\wedge \\ a_n^{k+1} & \uparrow & a_\infty^{k+1} \end{array}$$

Tästä seuraa että a_∞^k on monotoninen jono ja on olemassa $a' = \lim_{k \rightarrow \infty} a_\infty^k$.

Samoin, $\forall n$ kun $k \uparrow \infty$, $a_n^k \uparrow a_n^\infty$ ja $a_n^\infty \leq a_{n+1}^\infty$, ja seuraa että on olemassa monotoninen raja $a'' = \lim_{n \rightarrow \infty} a_n^\infty$.

Kun $a' = a'' = +\infty$ väite on tosi.

Jos olisi $a' < a'' = +\infty$, seuraisi ristiriita, koska silloin jokaiselle $N, \varepsilon > 0$ olisi olemassa n, k tarpeeksi suurilla joilla

$$N \leq a_n^\infty \leq a_n^k + \varepsilon \leq a_\infty^k + \varepsilon \leq a' + \varepsilon$$

Kun molemmat $a', a'' < \infty$, seuraa että $\forall \varepsilon > 0$ on olemassa \bar{n}, \bar{k} jolla

$$a'' < a_{\bar{n}}^\infty + \varepsilon, \quad a_\infty^{\bar{k}} < a_{\bar{n}}^{\bar{k}} + \varepsilon$$

Tästä seuraa

$$a' \geq a_{\infty}^{\bar{k}} \geq a_{\bar{n}}^{\bar{k}} \geq a_{\bar{n}}^{\infty} - \varepsilon \geq a'' - 2\varepsilon$$

Koska ε on mielivaltainen seuraa että $a' \geq a''$. Samoin seuraa $a'' \geq a'$.

Kun $n(l), k(l) \uparrow (+\infty)$ ovat kasvavia indeksijonoja,

$$\begin{aligned} a' &= \lim_{l \rightarrow \infty} a_{\infty}^{k(l)} \geq \lim_{l \rightarrow \infty} a_{n(l)}^{k(l)} \geq \lim_{l \rightarrow \infty} a_n^{k(l)} \quad \forall n, \\ a' &\geq \lim_{l \rightarrow \infty} a_{n(l)}^{k(l)} \geq \lim_{n \rightarrow \infty} \lim_{k \rightarrow \infty} a_n^k = a'' = a' \quad \square \end{aligned}$$

Huomautus 4.1.1. Yleisesti, ilman samasuuntaisen monotonisuuden oletusta tämä ei päde. Esimerkiksi, kun $g : \mathcal{X} \times \mathcal{Y} \rightarrow \mathbb{R}$ aina

$$\sup_x \inf_y g(x, y) \leq \inf_y \sup_x g(x, y),$$

mutta päinvastainen epäyhtälö ei päde ilman lisäoletuksia.

Lemma 4.1.2. Monotoninen konvergenssi lause yksinkertaisille satunnaismuuttujille

Olkoon $X, X_n \in \mathcal{Y}F^+$ jossa $0 \leq X_n(\omega) \uparrow X(\omega)$.

Silloin $E_P(X_n) \uparrow E_P(X)$.

Olkoon ensin $X(\omega) = \mathbf{1}_A(\omega)$, $A \in \mathcal{F}$. Kun $0 < \varepsilon < 1$, olkoon

$$A_n^\varepsilon = \{\omega : X_n(\omega) \geq (1 - \varepsilon)\} \subseteq A_{n+1}^\varepsilon \subseteq A$$

koska $X_n(\omega)$ on ei vähenevä ja $X_n(\omega) = 0$ kun $\omega \notin A$.

Seuraa $A_n^\varepsilon \uparrow A$, eli kun $\omega \in A$, myös $\omega \in A_n$ kun n on tarpeeksi suuri, eli $\forall \omega \exists \bar{n}(\omega)$ jolla $\forall n > \bar{n}(\omega)$

$$\begin{aligned} X_n(\omega) &> (\mathbf{1}_A(\omega) - \varepsilon) = \\ &, \text{ eli } (1 - \varepsilon), \text{ kun } \omega \in A. \end{aligned}$$

σ -additiivisuudesta seuraa $P(A_n^\varepsilon) \uparrow P(A)$ ja koska $X_n(\omega) \geq (1 - \varepsilon)\mathbf{1}_{A_n^\varepsilon}(\omega)$ seuraa

$$P(A) \geq E_P(X_n) \geq (1 - \varepsilon)P(A_n^\varepsilon) \uparrow (1 - \varepsilon)P(A)$$

Koska ε oli mielivaltainen $E_P(X_n) \uparrow P(A) = E_P(X)$. Odotusarvon lineaarisuuden nojalla väite seuraa myös kun $X \in \mathcal{Y}F$.

Lemma 4.1.3. *Olkoon $X(\omega) \in \mathcal{F}^+$. Jos $\{X_n\}, \{Y_n\} \subseteq \mathcal{YF}^+$, $X_n(\omega) \uparrow X(\omega)$ ja $Y_n(\omega) \uparrow X(\omega) \forall \omega$, seuraa*

$$\lim_n E_P(X_n) = \lim_n E_P(Y_n)$$

Tod. Jono $Z_m^n(\omega) = \min\{X_n(\omega), Y_m(\omega)\}$ on ei-vähenevä molempien indeksien n, m suhteen.

Koska $Y_n(\omega) \uparrow X(\omega) \geq X_n(\omega) \uparrow X(\omega) \geq Y_n(\omega)$ seuraa että

$$Z_m^n(\omega) \uparrow X_n(\omega) \text{ kun } m \uparrow \infty, \text{ ja } Z_m^n(\omega) \uparrow Y_m(\omega) \text{ kun } n \uparrow \infty$$

Kun otamme odotusarvoa, koska Z_m^n, X_n ja Y_m ovat yksinkertaisia seuraa lemmasta (4.1.2)

$$E_P(Z_m^n) \uparrow E_P(X_n) \text{ kun } m \uparrow \infty, \text{ ja } E_P(Z_m^n) \uparrow E_P(Y_m) \text{ kun } n \uparrow \infty,$$

lemmasta (4.1.1) seuraa

$$\lim_{n \rightarrow \infty} E_P(X_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} \lim_{m \rightarrow \infty} E_P(Z_m^n) = \lim_{m \rightarrow \infty} \lim_{n \rightarrow \infty} E_P(Z_m^n) = \lim_{n \rightarrow \infty} E_P(Y_n) \quad \square$$

Seuraus 4.1.1. *Kun $X_n(\omega) \uparrow X(\omega)$ jossa $\{X_n\} \subseteq \mathcal{YF}^+$ ja $X \in \mathcal{F}^+$, seuraa $E_P(X_n) \uparrow E_P(X)$.*

Tod. $E_P(Y)$:n määritelmästä seuraa että on olemassa $\{Y_n\} \subseteq \mathcal{YF}^+$ jolla $0 \leq Y_n(\omega) \leq X(\omega)$ ja $\lim_{n \rightarrow \infty} E_P(Y_n) = E_P(Y)$. Tässä väihteessä $Y_n(\omega)$ ei välttämättä kasvaa monotonisesti kaikille ω :lle.

Olkoon $X^{(n)}(\omega) := \alpha^{(n)}(X(\omega)) \uparrow X(\omega)$ (kts. 4.0.1), ja määritellään ei-vähenevä satunnaismuuttujien jono

$$Z_n(\omega) = \max\{X^{(n)}(\omega), Y_1(\omega), \dots, Y_n(\omega)\} \in \mathcal{YF}^+.$$

Koska $Z_n(\omega) \geq X^{(n)}(\omega) \uparrow X(\omega)$ seuraa että myös $Z_n(\omega) \uparrow X(\omega)$.

Koska $Y_n(\omega) \leq Z_n(\omega) \leq X(\omega)$ ja odotusarvo $E_P : \mathcal{YF}^+ \rightarrow [0, +\infty]$ on positiivinen ja lineaarinen operaattori

$$0 \leq E_P(Y_n) \leq E_P(Z_n(\omega)) \leq E_P(X(\omega)),$$

ja koska $\lim_n E_P(Y_n) = E_P(X(\omega))$ seuraa että $E_P(Z_n(\omega)) \uparrow E_P(X(\omega))$.

Lemmasta (4.1.3) seuraa nyt että

$$\lim_{n \rightarrow \infty} E_P(X_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} E_P(Z_n) = E_P(X) \quad \square$$

Teoreema 4.1.1. *Monotoninen konvergenssilause.*

Olkoon $X, X_n \in \mathcal{F}^+$ jossa $0 \leq X_n(\omega) \uparrow X(\omega)$ P -melkein varmasti, Silloin $E_P(X_n) \uparrow E_P(X)$.

Oletetaan ensin että jokaiselle ω : $0 \leq X_n(\omega) \uparrow X(\omega)$. Jokaiselle n :lle määritellään yksinkertaisten satunnaismuuttujien jonot $X_n^{(k)}(\omega) = \alpha^{(k)}(X_n(\omega)) \in \mathcal{YF}^+$ jolla $0 \leq X_n^{(k)}(\omega) \uparrow X_n(\omega)$ kun $k \uparrow \infty$. Seuraa lemmasta (4.1.2) että $E_P(X_n^{(k)}) \uparrow E_P(X_n)$ kun $k \uparrow \infty$.

Huomataan myös että kun $n \rightarrow \infty$, koska funktio $\alpha^{(k)}(x)$ on vasemmalta jatkuva ja $X_n(\omega) \uparrow X(\omega)$ seuraa että

$$X_n^{(k)}(\omega) \uparrow X^{(k)}(\omega) := \alpha^{(k)}(X(\omega)) \in \mathcal{YF}^+.$$

Koska funktiot $\alpha^{(k)}(x)$ ovat ei-väheneviä, seuraa myös että $X_n^{(k)}(\omega) \leq X_n^{(k+1)}(\omega)$. Koska odotusarvo $E_P : \mathcal{YF}^+ \rightarrow \mathbb{R}^+ \cup [0, +\infty]$ on positiivinen operattori, jono $\{E_P(X_n^{(k)}) : n, k \in \mathbb{N}\}$ on ei-vähenevä molempien indeksien suhteen ja lemmasta (4.1.1) seuraa

$$\lim_{n \rightarrow \infty} E_P(X_n) = \lim_{n \rightarrow \infty} \lim_{k \rightarrow \infty} E_P(X_n^{(k)}) = \lim_{k \rightarrow \infty} \lim_{n \rightarrow \infty} E_P(X_n^{(k)}) = \lim_{k \rightarrow \infty} E_P(X^{(k)}) = E_P(X)$$

jossa vasemmanpuolen yhtälö seuraa väitteestä (4.1.1).

Kun $0 \leq X_n(\omega) \uparrow X(\omega)$ P -melkein varmasti, on olemassa joukko $B \in \mathcal{F}$ jolla $P(B) = 1$ ja $0 \leq X_n(\omega)\mathbf{1}_B(\omega) \uparrow X(\omega)\mathbf{1}_B(\omega) \forall \omega$. Seuraa lauseista (4.0.3), (4.1.1) että

$$E_P(X_n) = E_P(X_n\mathbf{1}_B) \uparrow E_P(X\mathbf{1}_B) = E_P(X) \quad \square$$

Seuraus 4.1.2. *Odotusarvo $E_P : L^1(\Omega, \mathcal{F}, P) \rightarrow \mathbb{R}$ on positiivinen ja lineaarinen operattori.*

Tod. Harjoitustehtävä, approksimoivien yksinkertaisten satunnaismuuttujien avulla.

Lemma 4.1.4. *(Fatou lemma) Kun $X_n(\omega) \geq 0$ P -melkein varmasti $\forall n \in \mathbb{N}$,*

$$0 \leq E_P(\liminf_n X_n) \leq \liminf_n E_P(X_n)$$

Tämä seuraa myös kun $X_n(\omega) \geq Z(\omega) \forall n \in \mathbb{N}$ P -melkein varmasti, jossa $E_P(Z^-) < +\infty$.

Tod. Olkoon $Y_n(\omega) := \inf_{k \geq n} X_k(\omega)$, joka on ei-vähenevä $\forall \omega$, jolla $X_n(\omega) \geq Y_n(\omega) \uparrow \liminf_n X_n(\omega)$. Koska oletuksesta $Y_n(\omega) \geq 0$ P -m.v. monotonisesta konvergenssista seuraa

$$\liminf_n E_P(X_n) \geq \liminf_n E_P(Y_n) = \lim_n E_P(Y_n) = E_P(\liminf_n X_n)$$

Kun $X_n(\omega) \geq Z(\omega) \geq -(Z^-(\omega))$, jolla $E_P(Z^-) < +\infty$.

Koska $(X_n(\omega) + Z^-(\omega)) \geq 0$, ja odotusarvon lineaarisuudesta,

$$\begin{aligned} \liminf_n E(X_n) + E_P(Z^-) &= \liminf_n E_P(X_n + Z^-) \geq E_P(\liminf_n (X_n + Z^-)) \\ &= E_P(\liminf_n X_n) + E_P(Z^-) \geq 0 \end{aligned}$$

ja väite seuraa kun $E_P(Z^-) < \infty$.

Lemma 4.1.5. (käänteis-Fatou lemma) Jos $X_n(\omega) \leq Z(\omega) \leq Z^+(\omega) \forall n \in \mathbb{N}$ P -melkein varmasti jossa $E_P(Z^+) < \infty$, seuraa että

$$\limsup_n E_P(X_n) \leq E_P(\limsup_n X_n) \leq E(Z)$$

Tod. Sovelletaan Fatou lemmaa jonolle $X'_n(\omega) := -X_n(\omega) \geq -Z^+(\omega)$, ja väite seuraa koska $(\limsup_n a_n) = -(\liminf_n (-a_n)) \quad \square$

Lause 4.1.1. Lebesgue'n dominoidun konvergenssin lause. Kun

- $\lim_{n \rightarrow \infty} X_n(\omega) = X(\omega)$
- $\sup_{n \in \mathbb{N}} |X_n(\omega)| \leq Z(\omega)$ jossa $E_P(Z) < \infty$,

P -melkein varmasti (eli $\forall \omega \in N^c$ jossa $P(N) = 0$), siitä seuraa $\lim_{n \rightarrow \infty} E_P(X_n) = E_P(X)$

Todistus. Koska $|X_n| \leq Z$ ja $E_P(Z) < \infty$, Fatoun ja käänteis-Fatoun lemmat astuvat voimaan

$$E_P(X) = E_P(\liminf_n X_n) \leq \liminf_n E_P(X_n) \leq \limsup_n E_P(X_n) \leq E_P(\limsup_n X_n) = E_P(X) \quad \square$$

Lebesgue'n dominoidun konvergenssin lause pätee myös kun integroidaan σ -äärellisen mitan suhteen, esimerkiksi \mathbb{R}^d avarudessa Lebesguen mitalla varustettuna.

Lause 4.1.2. Olkoon (Ω, \mathcal{F}) mitallinen avaruus varustettu σ -äärellisellä mitalla $\lambda(d\omega)$, $(f_n(\omega))_{n \in \mathbb{N}}$, $f(\omega)$ mitalliset funktiot jossa

•

$$\lim_{n \rightarrow \infty} f_n(\omega) = f(\omega) \quad \forall \omega \in N^c$$

jossa $N \subset \Omega$ ja $\mu(N) = 0$.

• On olemassa integroituva yläraja $g(\omega) \geq 0$ jolla

$$|f_n(\omega)| \leq g(\omega) \quad \forall \omega \in N^c, n \in \mathbb{N} \text{ ja } \int_{\Omega} g(\omega) \lambda(d\omega) < \infty$$

Silloin

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\Omega} f_n(\omega) \lambda(d\omega) = \int_{\Omega} \left(\lim_{n \rightarrow \infty} f_n(\omega) \right) \lambda(d\omega) = \int_{\Omega} f(\omega) \lambda(d\omega)$$

Tod. Voidaan olettaa $f_n(\omega) \geq 0 \quad \forall \omega \in \Omega, n \in \mathbb{N}$, muuten hajotetaan $f_n(\omega) = f_n(\omega)^+ - f_n(\omega)^-$ ja integroidaan erikseen.

Koska λ on σ -äärellinen, on olemassa numeroituva mitallinen ositus $(\Omega_n : n \in \mathbb{N}) \subset \mathcal{F}$ jolla $\Omega_i \cap \Omega_j = \emptyset$ kun $i \neq j$, $\Omega = \bigcup_{i \in \mathbb{N}} \Omega_i$ ja $0 < \lambda(\Omega_i) < \infty \quad \forall i \in \mathbb{N}$.

Määritellään todennäköisyyssmittojen jono

$$P_i(A) := \frac{\lambda(A \cap \Omega_i)}{\lambda(\Omega_i)}, \quad A \in \mathcal{F}$$

Huomataan että

$$\int_{\Omega} g(\omega) \lambda(d\omega) = \sum_{i \in \mathbb{N}} \lambda(\Omega_i) \int_{\Omega} g(\omega) P_i(d\omega) < \infty$$

josta seuraa $g(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P_i) \quad \forall i$. Lebesgue dominoidun konvergenssin lause 4.1.1 soveltuu jokaisen P_i mitan suhteen:

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\Omega} f_n(\omega) P_i(d\omega) = \int_{\Omega} f(\omega) P_i(d\omega)$$

Väite seuraa koska

$$\begin{aligned} \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\Omega} f_n(\omega) \lambda(d\omega) &= \lim_{n \rightarrow \infty} \lim_{m \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^m \int_{\Omega_i} f_n(\omega) \lambda(d\omega) = \lim_{m \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^m \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\Omega_i} f_n(\omega) \lambda(d\omega) \\ &= \lim_{m \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^m \int_{\Omega_i} \left(\lim_{n \rightarrow \infty} f_n(\omega) \right) \lambda(d\omega) = \lim_{m \rightarrow \infty} \sum_{i=1}^m \int_{\Omega_i} f(\omega) \lambda(d\omega) = \int_{\Omega} f(\omega) \lambda(d\omega) \end{aligned}$$

jossa käytettiin lemma (4.1.1) jonolle $\left\{ \sum_{i=1}^m \int_{\Omega_i} f_m(\omega) \lambda(d\omega) : m, n \in \mathbb{N} \right\}$ □

Esimerkki 4.1.1. Olkoon $\Omega = [0, 1]$, $\mathcal{F} = \mathcal{B}([0, 1])$, ja P on tasainen jakauma jolla $P((a, b]) = (b - a)$ kun $0 \leq a \leq b \leq 1$.

Olkoon $X_n(\omega) = n\mathbf{1}(\omega \leq 1/n)$.

Huomataan että kun $\omega \neq 0$, $X_n(\omega) \rightarrow 0$ kun $n \rightarrow \infty$, koska $X_n(\omega) = 0$ kun $n > 1/\omega$. Koska $P((0, 1]) = 1$, $X_n(\omega) \rightarrow 0$ P -melkein varmasti.

Toisaalta $E_P(X_n) = nn^{-1} = 1 > 0 = E_P(\lim_n X_n)$.

Lebesguen dominoidun konvergenssi lauseen hypoteesi ei päde.

$$\begin{aligned} X^*(\omega) &= \sup_n X_n(\omega) = n \text{ kun } \omega \in \left(\frac{1}{n+1}, \frac{1}{n} \right] \iff \omega^{-1} \in [n, n+1) \\ \text{eli } X^*(\omega) &= \lfloor \omega^{-1} \rfloor \text{ ja } (\omega^{-1} - 1) < X^*(\omega) < \omega^{-1} \end{aligned}$$

Tästä seuraa

$$E_P(X^*) > \left(\int_0^1 x^{-1} dx \right) - 1 = \int_0^1 d \log(x) - 1 = \log(1) - \log(0) - 1 = +\infty$$

eli X^* ei ole integroitava ja dominoidun konvergenssin lause ei pysty soveltamaan.

Lemma 4.1.6. Olkoon s.m. $X(\omega) \in \mathbb{R}^d$, ja $Y(\omega) = g(X(\omega)) \in \mathbb{R}$,

jossa $g : (\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ on mitallinen kuvaus. Silloin

$$\int_{\mathbb{R}^d} g(x) P_X(dx) = E_P(g(X)) = \int_{\Omega} g(X(\omega)) P(d\omega) = E_P(Y) = \int_{\mathbb{R}} y P_Y(dy)$$

jossa $P_Y(D) = P(Y^{-1}(D)) = P_X(g^{-1}(D))$ kun $D \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$.

Tod. kun $g(x) = \mathbf{1}_B(x)$ jossa $B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$ väite seuraa suoraan P_X ja P_Y mittojen määritelmästä, ja siksi väite on totta myös kun kuvaus $g(x)$ saa äärellistä monta arvoa.

Voidaan olettaa että $g(x) \geq 0$, muuten hajotetaan ensin $g(x) = g^+(x) - g^-(x)$. Silloin on olemassa yksinkertaisten kuvausten jono $g^{(N)}(x) \uparrow g(x) \forall x \in \mathbb{R}^d$ (kts. 4.0.1), jolla myös $g^{(N)}(X(\omega)) \uparrow g(X(\omega))$. Monotonisen konvergenssilauseesta seuraa että

$$\int_{\Omega} g^{(N)}(X(\omega))P(d\omega) \uparrow \int_{\Omega} g(X(\omega))P(d\omega) \text{ ja } \int_{\mathbb{R}^d} g^{(N)}(x)P_X(dx) \uparrow \int_{\mathbb{R}^d} g(x)P_X(dx),$$

$$\text{jossa } \int_{\Omega} g^{(N)}(X(\omega))P(d\omega) = \int_{\mathbb{R}^d} g^{(N)}(x)P_X(dx) \quad \square$$

Esimerkki 4.1.2. Jos satunnaismuuttujan X jakauman kertymäfunktio $F_X(x) = P(X \leq x)$ on derivoituva derivaatalla $f_X(x)$ (joka kutsutaan jakauman tiheysfunktiksi), ja $g(x) \geq 0$ on Borel mitallinen funktio,

$$E_P(g(X)) = \int_{\Omega} g(X(\omega))P(d\omega) = \int_{\mathbb{R}} g(x)F(dx) = \int_{\mathbb{R}} g(x)f_X(x)dx$$

Tämä pätee yleisemmin silloin kun $F_X(x)$ on absoluuttisesti jatkuva Lebesgue mitan suhteen, eli

$$F_X(b) = F_X(a) + \int_a^b f_X(t)dt$$

jossa Borel mitallinen funktio $f_X(t) \geq 0$ on jakauman tiheysfunktio. Silloin $f_X(t) = \frac{dF_X}{dt}(t) = \frac{dP_X}{dt}(t)$ on P_X mitan Radon-Nikodym derivaatta Lebesgue mitan suhteen.

Erityisesti olkoon $X(\omega) \geq 0$ λ -eksponentiaalinen satunnaismuuttuja, jossa $\lambda > 0$ on parametri, ja kertymäfunktio $P(X \leq x) = F_X(x) = 1 - \exp(-\lambda x^+)$ jossa $\lambda > 0$, $x^+ = x \vee 0$. Lasketaan

$$E_P(X) = \int_0^{\infty} xF_X(dx) = \int_0^{\infty} x \frac{d}{dx} F_X(x) dx = \int_0^{\infty} x \lambda \exp(-\lambda x) dx =$$

$$\lambda \left[x \exp(-\lambda x) \right]_0^{+\infty} + \int_0^{\infty} \exp(-\lambda x) dx = 0 - 0 - \frac{1}{\lambda} \left[\exp(-\lambda x) \right]_0^{\infty} = \frac{1}{\lambda}$$

4.2 Odotusarvon sovellus: mitan vaihto

Todennäköisyys avaruudessa (Ω, \mathcal{F}, P) , olkoon Z satunnaismuuttuja jolla $Z(\omega) \geq 0$ P -melkein varmasti ja $0 < E_P(Z) < \infty$ (tästä seuraa $P(\{\omega : Z(\omega) > 0\}) > 0$).

Määritellään uusi todennäköisyysmitta $Q : \mathcal{F} \rightarrow [0, 1]$

$$Q(A) := \frac{E_P(Z\mathbf{1}_A)}{E_P(Z)} \quad \forall A \in \mathcal{F}$$

Q on todennäköisyysmitta: Selvästi on additiivinen ja $Q(\Omega) = 1$. Osoitamme että on myös σ -additiivinen: kun $A_n \uparrow \Omega$, myös $Z(\omega)\mathbf{1}_{A_n}(\omega) \uparrow Z(\omega)$ P -melkein varmasti. Monotonisen konvergenssin lauseesta (4.1.1) seuraa

$$Q(A_n)E_P(Z) = E_P(Z\mathbf{1}_{A_n}) \uparrow E_P(Z) = Q(\Omega)E_P(Z) \implies Q(A_n) \uparrow 1$$

Voidaan myös käyttää normalisoitua muuttujaa

$$\tilde{Z}(\omega) := \frac{Z(\omega)}{E_P(Z)}$$

jolla $E_P(\tilde{Z}) = 1$, ja kirjoittaa $Q(A) = E_P(\tilde{Z}\mathbf{1}_A)$.

Teoreema 4.2.1. $\forall A \in \mathcal{F} P(A) = 0 \implies Q(A) = 0$. Sanotaan että Q on *absoluttisesti jatkuva* P :n suhteen, ja merkitään $Q \ll P$.

Tod. kun $P(A) = 0$, $Z(\omega)\mathbf{1}_A(\omega) = 0$ P -melkein varmasti.

Teoreema 4.2.2. Kun $X \in \mathcal{F}^+$,

$$E_Q(X) = \frac{E_P(XZ)}{E_P(Z)},$$

ja $X \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, Q)$ jos ja vain jos $(XZ) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$.

Tod. Kun $X(\omega) \in \mathcal{Y}F^+$, väite seuraa suoraan määritelmästä ja odotusarvon lineaarisuudesta. Kun $X \in \mathcal{F}^+$ on olemassa jono $\{X_n\} \subseteq \mathcal{Y}F^+$ jolle $0 \leq X_n(\omega) \leq X(\omega) \forall \omega$. Soveltamalla Monotonisen konvergenssin lauseen kaksi kertaa Q mitan alla ja P mitan alla, seuraa että $E_Q(X_n) \uparrow E_Q(X)$ ja

$$E_Q(X_n) = \frac{E_P(X_n Z)}{E_P(Z)} \uparrow \frac{E_P(XZ)}{E_P(Z)} \quad \square$$

4.2.1 Uskottavuusosamäärä

Olemme rakentaneet mitan $Q \ll P$ satunnaismuuttujan $Z \in L^1(P)$ avulla. Tämä tulos kääntyy toisinpäin, kun $Q \ll P$ on olemassa $0 \leq Z(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$ jolle mitanvaihto kaava $Q(A) = E_P(Z\mathbf{1}_A)$ on voimassa.

Teoreema 4.2.3. (Radon-Nikodym lause) Todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}) olkoon P, Q todennäköisyysmittoja (yleisemmin P voisi olla σ -äärellinen mitta), joilla $Q(A) = 0$ aina kun $A \in \mathcal{F}$ ja $P(A) = 0$ (merkintä: $Q \ll_{\mathcal{F}} P$). Silloin on olemassa satunnaismuuttuja $0 \leq Z(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$ jolle $E_P(Z) = 1$ ja

$$Q(A) = E_P(Z\mathbf{1}_A) \quad \forall A \in \mathcal{F}$$

$Z(\omega)$ on yksikäsitteinen vailla P -nolla joukkoja. Merkitään

$$Z(\omega) = \frac{dQ}{dP}(\omega),$$

joka kutsutaan uskottavuus-osamääräksi (engl. likelihood ratio) tai Radon-Nikodym derivaataksi.

R-N lause todistetaan kurssin loppupuolella martingaalien avulla.

Mitanvaihto-kaava saa muotoa

$$E_Q(X) = \int_{\Omega} X(\omega)Q(d\omega) = \int_{\Omega} X(\omega) \frac{dQ}{dP}(\omega) P(d\omega)$$

Määritelmä 4.2.1. Todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}) todennäköisyysmitat P ja P' ovat singulaarisia (merkintä: $P \perp P'$), kun on olemassa $A \in \mathcal{F}$ jolla $P(A) = 0$ ja $P'(A) = 1$.

Esimerkki 4.2.1. Todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}, P) olkoon $\mathcal{F} = \sigma(X)$ jossa $X(\omega)$ on standardi-gaussinen satunnaismuuttuja jolla $E(X) = 0$, $E(X^2) = 1$, eli

$$P(X \in dx) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{x^2}{2}\right)dx$$

Olkoon P' toinen todennäköisyysmitta jolla

$$P'(X_i \in dx) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{(x - \mu)^2}{2}\right)dx$$

Laskemme uskottavuusosamäärät

$$Z'(\omega) = \frac{dP'}{dP}(\omega) \quad \text{ja} \quad Z(\omega) = \frac{dP}{dP'}(\omega) = \frac{1}{Z'(\omega)}$$

R-N lauseesta seuraa että $Z'(\omega)$ on $\sigma(X)$ mitallinen, siksi on olemassa Borel mitallinen kuvaus $z : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+$ jolla $Z'(\omega) = z'(X(\omega))$ (harjoitustehtävä).

Silloin, kaikille Borel mitallisille funktioille $f(x) \geq 0$

$$\begin{aligned} \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{\mathbb{R}} f(x) \exp\left(-\frac{(x-\mu)^2}{2}\right) dx &= E_{P'}(f(X)) = E_P(f(X)Z') \\ &= E_P(f(X)z'(X)) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{\mathbb{R}} f(x)z'(x) \exp\left(-\frac{x^2}{2}\right) dx \end{aligned}$$

josta seuraa

$$\begin{aligned} z'(x) &= \exp\left(\mu x - \frac{1}{2}\mu^2\right), \\ Z'(\omega) &= \exp\left(\mu X(\omega) - \frac{1}{2}\mu^2\right) \end{aligned}$$

Koska $E_P(Z') = 1$, seuraa

$$E_P(\exp(\mu X)) = \exp\left(\frac{1}{2}\mu^2\right)$$

4.2.2 Lebesguen hajotelma

Olkoon P, P' todennäköisyysmittoja todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}) , joilla ei välttämättä $P \ll P'$ tai $P' \ll P$.

$Q := \frac{1}{2}(P + P')$ on todennäköisyysmitta jolla selvästi $P \ll Q$ ja $P' \ll Q$ σ -algebrassa \mathcal{F} .

R-N lauseesta (4.2.3) seuraa että uskottavuusosamäärät

$$\zeta(\omega) := \frac{dP}{dQ}(\omega) \quad \text{ja} \quad \zeta'(\omega) := \frac{dP'}{dQ}(\omega),$$

ovat olemassa, ei-negatiivisiä ja \mathcal{F} -mitallisia.

Huomataan että koska $\forall \omega$

$$\zeta(\omega) + \zeta'(\omega) = \frac{2dP}{d(P + P')}(\omega) + \frac{2dP'}{d(P + P')}(\omega) = 2 \frac{d(P + P')}{d(P + P')}(\omega) = 2$$

ja $\zeta(\omega) \geq 0, \zeta'(\omega) \geq 0$ seuraa

$$\zeta(\omega) \leq 2, \zeta'(\omega) \leq 2 \quad Q \text{ m.v.,} \quad \text{ja} \quad Q(\{\omega : \zeta(\omega) = 0\} \cap \{\omega : \zeta'(\omega) = 0\}) = 0.$$

Määritellään $\forall \omega \in \Omega$

$$Z(\omega) = \frac{dP}{dP'}(\omega) := \frac{\zeta(\omega)}{\zeta'(\omega)} \quad \text{ja} \quad Z'(\omega) = \frac{dP'}{dP}(\omega) := \frac{\zeta'(\omega)}{\zeta(\omega)} = \frac{1}{Z(\omega)}$$

jossa $0/0$ saa mielivaltaisen arvo, esimerkiksi 0.

Mitan-vaihto kaavan yleistys on

$$E_{P'}(X) = E_P(XZ') + E_{P'}(X\mathbf{1}(\zeta = 0))$$

kun $X \in \mathcal{F}^+$.

Todistus

$$\begin{aligned} E_{P'}(X) &= E_{P'}(X\{\mathbf{1}(\zeta > 0) + \mathbf{1}(\zeta = 0)\}) = E_Q(X\zeta'\mathbf{1}(\zeta > 0)) + E_{P'}(X\mathbf{1}(\zeta = 0)) \\ &= E_Q\left(X\frac{\zeta'}{\zeta}\mathbf{1}(\zeta > 0)\right) + E_{P'}(X\mathbf{1}(\zeta = 0)) = E_Q(XZ'\zeta) + E_{P'}(X\mathbf{1}(\zeta = 0)) \\ &= E_P(XZ') + E_{P'}(X\mathbf{1}(\zeta = 0)) = E_P(XZ') + E_{P^\perp}(X) \end{aligned}$$

jossa

$$P^\perp(d\omega) := \mathbf{1}(\zeta(\omega) = 0)P'(d\omega),$$

Siis

$$P'(d\omega) = Z'(\omega)P(d\omega) + \mathbf{1}(\zeta(\omega) = 0)P'(d\omega) = Z'(\omega)P(d\omega) + P^\perp(d\omega)$$

P ja P^\perp ovat singulaarisia, koska joukolle $A := \{\omega : \zeta(\omega) = 0\}$ pätee

$$P(A) = 0 \text{ ja } P^\perp(A) = P^\perp(\Omega)$$

Koska $P^\perp(\Omega) + E_P(Z') = P'(\zeta = 0) + E_P(Z') = 1$, P^\perp on todennäköisyyksmitta jos ja vain jos $P \perp P'$, (silloin $P^\perp = P'$). Myös $E_P(Z') \leq 1$ ja $E_P(Z') = 1$ jos ja vain jos $P' \ll P$, silloin $P^\perp = 0$.

Esimerkki: Ehdollinen todennäköisyys Olkoon $B \in \mathcal{F}$ jolla $P(B) > 0$, ja suoritamme mitan vaihdon satunnaismuuttujalla $Z(\omega) = \mathbf{1}_B(\omega)$, saadaan

$$P(A|B) := \frac{E_P(\mathbf{1}_A \mathbf{1}_B)}{E_P(\mathbf{1}_B)} = \frac{P(A \cap B)}{P(B)}, \quad A \in \mathcal{F}$$

Kuvaus $P(\cdot | B) : \mathcal{F} \rightarrow [0, 1]$ on todennäköisyysmitta, joka kutsutaan ehdolliseksi todennäköisyydeksi ehdolla B tapahtuman.

De Finettin vedonlyöntimeklararin näkökulmasta $P(A|B)$ on A tapahtuman hinta johdonmukaisessa hinnoittelujärjestelmässä P , silloin kun tiedetään että B tapahtuu. Hajotelmasta

$$P(A \cap B) = P(B)P(A|B) = P(A)P(B|A)$$

on paljon hyötyä monimutkaisten tapahtumien todennäköisyyksien laskemisessa.

Lemma 4.2.1. • Kun $(A_i : i \in \mathbb{N}) \subseteq \mathcal{F}$ on tapahtumien jono jolla $P(A_i \cap A_k) = 0, i \neq j, P(\bigcup_{i \in \mathbb{N}} A_i) = 1$, seuraa $P(B) = \sum_{i \in \mathbb{N}} P(B|A_i)P(A_i)$

• Kun $P(B \cap C) > 0, P(A|B \cap C) = \frac{P(A \cap B \cap C)}{P(B \cap C)}$

•

$$P(A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n) = P(A_1)P(A_2|A_1) \dots P(A_n | A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_{n-1})$$

Tod.: harjoitustehtävä.

Satunnaismuuttujan $X \in L^1(P)$ ehdollinen odotusarvo ehdolla B tapahtuman on

$$E_P(X|B) := \frac{E_P(X \mathbf{1}_B)}{P(B)}$$

Huomaamme että tässä vaiheessa ehto $P(B) > 0$ on välttämätön. Miten ehdollisen odotusarvon käsite yleistyy P -nolla mittaisille tapahtumille B ? Vastaus esitetään kurssin loppupuolella.

Luku 5

Riippumattomuus

Määritelmä 5.0.2. • Olkoon $A, B \in \mathcal{F}$. Sanomme että A ja B ovat riippumattomia P -mitan suhteen (merkintä: $A \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} B$) kun

$$P(A)P(B) = 0 \quad \text{tai} \quad P(A|B) := \frac{P(A \cap B)}{P(B)} = P(A)$$

eli ehdollistaminen ei muuttaa todennäköisyyttä. Kun $P(A|B) = P(A)$ myös $P(B|A) = P(B)$ ja $P(A \cap B) = P(A)P(B)$.

- Yleisemmin tapahtumat A_1, A_2, \dots, A_n ovat riippumattomia P -mitan suhteen kun jokaiselle indeksien alijoukolle $I \subseteq \{1, \dots, n\}$,

$$P\left(\bigcap_{i \in I} A_i\right) = \prod_{i \in I} P(A_i)$$

merkintä: $(A_1, A_2, \dots, A_n) \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp}$.

- Satunnaismuuttujat $X_1(\omega), \dots, X_n(\omega)$ jossa $X_i : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\mathbb{R}^{d_i}, \mathcal{B}(\mathbb{R}^{d_i}))$ $i = 1, \dots, n$ ovat riippumattomia P -mitan suhteen kun $\forall B_i \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^{d_i})$ $i = 1, \dots, n$

$$P(X_1 \in B_1, X_2 \in B_2, \dots, X_n \in B_n) = P(X_1 \in B_1)P(X_2 \in B_2) \dots P(X_n \in B_n)$$

merkintä: $(X_1, X_2, \dots, X_n) \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp}$.

- σ -algebrat $\mathcal{G}_1, \dots, \mathcal{G}_n \subseteq \mathcal{F}$ ovat riippumattomia P -mitan suhteen kun $\forall A_i \in \mathcal{G}_i, i = 1, \dots, n$,

$$P(A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n) = P(A_1)P(A_2) \dots P(A_n)$$

merkintä: $(\mathcal{G}_1, \mathcal{G}_2, \dots, \mathcal{G}_n) \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp}$.

Huomautus 5.0.1. • Olkoon $A, B \in \mathcal{F}$, kun $A \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} B$, myös $(A^c) \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} B$.

- Olkoon $g : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ on Borel mitallinen kuvaus. Satunnaismuuttujille joilla $(X_1, \dots, X_n) \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} Y$ seuraa $g(X_1, X_2, \dots, X_n) \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} Y$.
- Kun $A \in \mathcal{F}$ ja $A \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} A$, seuraa että $P(A) = 0$, tai $P(A) = 1$.
- Huomataan että parittaisesta riippumattomuudesta $A_i \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} A_j \forall 1 \leq i \neq j \leq n$, yleisesti ei seuraa $(A_1, A_2, \dots, A_n) \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp}$.

Esimerkki 5.0.2. Olkoon $A, B \in \mathcal{F}$ jolla $A \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} B$ ja $P(A) = P(B) = 1/2$.

Olkoon $C = (A \cap B) \cup (A^c \cap B^c)$. Silloin $C \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} A$ ja $C \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} B$. Vaikka kaikki tapahtumat ovat parittain riippumattomia P :n suhteen, kolmikkona tapahtumat A, B, C eivät ole P -riippumattomia.

Todistukset: harjoitustehtävät.

Määritelmä 5.0.3. Olkoon (Ω, \mathcal{F}, P) todennäköisyysavaruus ja $\mathcal{F}_i \subset \mathcal{F}$, $i = 1, \dots, n$, $\mathcal{G} \subset \mathcal{F}$, ali σ -algebrat.

Sanotaan että σ -algebrat $\mathcal{F}_1, \dots, \mathcal{F}_n$ ovat ehdollisesti P -riippumattomia ehdolla \mathcal{G} σ -algebran, jos $\forall G \in \mathcal{G}$ jolla $P(G) > 0$, $A_i \in \mathcal{F}_i : i = 1, \dots, n$

$$P(A_1 \cap A_2 \cap \dots \cap A_n | G) = \prod_{i=1}^n P(A_i | G)$$

Lemma 5.0.2. Satunnaismuuttujat X_1, \dots, X_n ovat P -riippumattomia jos ja vain jos kaikille ei-negatiivisille Borel mitalliselle funktioille $g_k : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+$, pätee

$$E_P(g_1(X_1) \dots g_n(X_n)) = E_P(g_1(X_1)) \dots E_P(g_n(X_n)) \quad (5.0.1)$$

Tod. Kun valitsemme $g_k(x) = \mathbf{1}_{B_k}(x)$ jossa $B_k \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$, \Leftarrow implikaatio seuraa.

Toisinpäin, jos X_1, \dots, X_n ovat P -riippumattomia, (5.0.1) pätee Borelin joukkojen indikaattoreille.

Silloin kun $g_k(x) = \sum_{i=1}^{m_k} y_{i,k} \mathbf{1}_{B_{i,k}}(x)$,

$$\begin{aligned} E_P(g_1(X_1) \cdots g_n(X_n)) &= E_P\left(\prod_{k=1}^n \left\{ \sum_{i=1}^{m_k} y_{i,k} \mathbf{1}_{B_{i,k}}(X_k) \right\}\right) \\ &= \sum_{i_1=1}^{m_1} \cdots \sum_{i_n=1}^{m_n} y_{i_1,1} \cdots y_{i_n,n} P(X_1 \in B_{i_1,1}, \dots, X_n \in B_{i_n,n}) \\ &= \sum_{i_1=1}^{m_1} \cdots \sum_{i_n=1}^{m_n} y_{i_1,1} \cdots y_{i_n,n} P(X_1 \in B_{i_1,1}) \cdots P(X_n \in B_{i_n,n}) \\ &= \prod_{k=1}^n E_P\left(\left\{ \sum_{i=1}^{m_k} y_{i,k} \mathbf{1}_{B_{i,k}}(X_k) \right\}\right) = E_P(g_1(X_1)) \cdots E_P(g_n(X_n)) \end{aligned}$$

Jos $g_k^{(N)}(x)$ ovat yksinkertaisia Borelin funktioita $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+$ jolla

$$0 \leq g_k^{(N)}(x) \uparrow g_k(x), \text{ kun } N \uparrow \infty, \forall k = 1, \dots, n$$

myös niiden tulot ovat Borelin funktioita $\mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}^+$ jotka kasvavat monotonisesti

$$(g_1^{(N)}(x_1) \cdots g_n^{(N)}(x_n)) \uparrow (g_1(x_1) \cdots g_n(x_n)),$$

ja väite seuraa monotonisen konvergenssin lauseesta.

5.0.3 Lovaszin lokaali lemma ¹

Tässä luvussa näytämme miten paljon saa aikaiseksi pelaamalla pelkätään induktiolla ja ehdollisen todennäköisyyden määritelmällä.

Kun tapahtumat A_1, \dots, A_n ovat P -riippumattomia, myös komplementit ovat P -riippumattomia, ja

$$P\left(\bigcap_{i=1}^n A_i^c\right) = \prod_{i=1}^n (1 - P(A_i))$$

Lovasz lokaali lemma antaa samankaltaisen alarajan silloin kun "tapahtumien riippuvuus on tarpeeksi harva".

¹Tämä kappale voidaan sivuuttaa

Lemma 5.0.3. (Paul Erdős ja Lazlo Lovasz 1975) Olkoon $\{A_1, \dots, A_n\} \subseteq \mathcal{F}$ tapahtumat todennäköisyysavaruudesta (Ω, \mathcal{F}, P) , ja (V, E) graafi solmujen joukolla $V = \{1, 2, \dots, n\}$ ja särmöjen joukolla $E \subseteq V \times V$.

Oletetaan että (V, E) on suunnaton, eli $\forall i, j \in V (i, j) \in E \iff (j, i) \in E$ ja silloin merkitään $i \sim j$, ja $(i, i) \notin E$ (merkintä: $i \not\sim i$), ja on olemassa vektori $(x_1, \dots, x_n) \in [0, 1]^n$ jolla

$$P\left(A_i \mid \bigcap_{j \in S} A_j^c\right) \leq x_i \prod_{j \sim i} (1 - x_j)$$

pätee $\forall i \in V, S \subseteq V$ joilla $\{i\} \cup \{j : j \sim i\} \subseteq S^c$ ja $P\left(\bigcap_{j \in S} A_j^c\right) > 0$.

Silloin $\forall S, S' \subseteq V$ jolla $S \cap S' = \emptyset$,

$$P\left(\bigcap_{i \in S} A_i^c \mid \bigcap_{j \in S'} A_j^c\right) \geq \prod_{i \in S} (1 - x_i) > 0$$

Erityisesti kun $S' = \emptyset$, $P\left(\bigcap_{i \in S} A_i^c\right) \geq \prod_{i \in S} (1 - x_i) > 0$, josta seuraa $\bigcap_{i \in S} A_i^c \neq \emptyset$.

Todistus Käytämme induktiota kokonaiskardinaaliteetin $n = |S| + |S'|$ suhteen. Väite on triviaali kun $n = 1$, joka tarkoittaa $|S| = 1, S' = \emptyset$.

Osoitetaan ensin että väite on tosi kun $|S| = 1, S = \{i\}$ ja $i \notin S'$.

Olkoon $S' = S'' \cup S'''$ jossa $S'' = S' \cap \{j \sim i\}$, $S''' = S' \cap \{j : j \not\sim i\}$.

Silloin

$$P\left(A_i \mid \bigcap_{j \in S'} A_j^c\right) = \frac{P\left(A_i, \bigcap_{j \in S''} A_j^c \mid \bigcap_{j \in S'''} A_j^c\right)}{P\left(\bigcap_{j \in S''} A_j^c \mid \bigcap_{j \in S'''} A_j^c\right)}$$

jossa

$$P\left(A_i, \bigcap_{j \in S''} A_j^c \mid \bigcap_{j \in S'''} A_j^c\right) \leq P\left(A_i \mid \bigcap_{j \in S'''} A_j^c\right) \leq x_i \prod_{j \sim i} (1 - x_j)$$

ja koska $|S''| + |S'''| = |S'| < 1 + |S'| = n$ induktion oletuksesta seuraa

$$P\left(\bigcap_{j \in S''} A_j^c \mid \bigcap_{j \in S'''} A_j^c\right) \geq \prod_{j \in S''} (1 - x_j) \geq \prod_{j \sim i} (1 - x_j)$$

josta seuraa $P\left(A_i^c \mid \bigcap_{j \in S'} A_j^c\right) \geq (1 - x_i)$.

Kun $\{i\} \subsetneq S$ ja $S' \cap S = \emptyset$, hajotetaan $S = \{i\} \cup (S \setminus \{i\})$,

$$\begin{aligned} P\left(\bigcap_{k \in S} A_k^c \mid \bigcap_{j \in S'} A_j^c\right) &= P\left(A_i^c \mid \bigcap_{j \in S' \cup S \setminus \{i\}} A_j^c\right) P\left(\bigcap_{k \in S \setminus \{i\}} A_k^c \mid \bigcap_{j \in S'} A_j^c\right) \\ &\geq (1 - x_i) \prod_{k \in S \setminus \{i\}} (1 - x_k) = \prod_{i \in S} (1 - x_i) > 0 \quad \square \end{aligned}$$

jossa induktio-oletus astuu voimaan koska $|S \setminus \{i\}| + |S'| = |S| + |S'| - 1$.

□

Seuraus 5.0.1. Oletetaan että (V, E) on riippuvuuden graafi, jossa

$\forall i \in V, S \subseteq V$ jolla $S^c \subseteq \{i\} \cup \{j : j \sim i\}$,

tapahtuma A_i on P -riippumaton tapahtumasta $\left(\bigcap_{j \in S} A_j\right)$.

Toisin sanoen A_i on P -riippumaton σ -algebrasta $\sigma(A_j : j \neq i \text{ ja } j \not\sim i)$.

1. Kun on olemassa lukuja $x_i \in [0, 1), i = 1, \dots, n$ jolla

$$P(A_i) \leq x_i \prod_{j \sim i} (1 - x_j),$$

seuraa $P\left(\bigcap_{i \in S} A_i^c\right) \geq \prod_{i \in S} (1 - x_i), \quad \forall S \subseteq V, \text{ erityisesti } \left(\bigcap_{i \in S} A_i^c\right) \neq \emptyset$.

2. Erityisesti, kun $\#\{j : j \sim i\} \leq d$, ja $P(A_i) \leq \exp(-1)/(d+1), \forall i \in V$,
seuraa

$$P\left(\bigcap_{i=1}^n A_i^c\right) \geq \left(1 - \frac{1}{d+1}\right)^n > 0$$

Todistus

1. Yleisen Lovaszin lemmän oletus seuraa riippumattomuuden nojalla.

2. Tarvitaan x jolla $p \leq x(1-x)^d$. Kun $x = (1+d)^{-1}$, ensimmäisen osan oletus seuraa koska

$$P(A_i) \leq \frac{\exp(-1)}{d+1} \leq \frac{1}{d+1} \left(1 - \frac{1}{d+1}\right)^d = x(1-x)^d \quad \square$$

$$\text{jossa } \exp(-1) \leq \left(1 - (d+1)^{-1}\right)^d \quad \square$$

Esimerkki 5.0.3. *Dataverkossa on n solmuparia, ja jokaiselle solmuparin p välissä on joukko J_p mahdollisia reittejä.*

Oletetaan että $|J_p| = m$ jokaiselle parille p , ja kun $p \neq p'$ jokaiselle reitille $r \in J_p$ pätee

$$|\{r' \in J_{p'} \text{ jolla reitit } r \text{ ja } r' \text{ leikkaavat toisiinsa}\}| \leq k$$

Kun k ei ole liian suuri, on mahdollista yhdistää jokaista solmujen paria, reitityksillä jossa kaikki reitit eivät leikkaa toisiinsa.

Tod. *Jokaiselle solmujen parille p valitaan riippumattomasti tasaisesta jakaumasta satunnaisreitti R_p joukosta J_p . Määritellään jokaiselle solmujen parien parille $p \neq p'$ tapahtuma*

$$A_{p,p'} = \{ \text{satunnaisreitit } R_p \text{ ja } R_{p'} \text{ leikkaavat toisiinsa} \}.$$

Selvästi $P(A_{p,p'}) \leq k/m$. Huomataan myös että

$$A_{p,p'} \perp\!\!\!\perp \sigma(A_{q,q'} : q \neq p, p', \text{ ja } q' \neq p, p')$$

Seuraa että on $d = 2(n-1)$ tapahtumaa, $A_{p,r}$ jolla $r \neq p$ ja $A_{r',p'}$ jolla $r' \neq p'$, jotka ovat P -riippuvaisia tapahtumasta $A_{p,p'}$. Siis tapahtuman $A_{p,p'}$ aste (naapureiden määrä) tapahtumien riippuvuusgrafissa on $d = 2(n-1)$.

Silloin kun

$$P(A_{p,p'}) \leq k/m \leq \frac{\exp(-1)}{d+1} \leq (d+1)^{-1} \left(1 - (d+1)^{-1}\right)^d$$

eli $k \leq m \exp(-1)/(2n-1)$, Lovászín lemma astuu voimaan ja

$$P\left(\bigcap_{p,p'} A_{p,p'}^c\right) > \left(1 - (d+1)^{-1}\right)^{n(n-1)/2} > 0,$$

josta seuraa $\left(\bigcap_{p,p'} A_{p,p'}^c\right) \neq \emptyset$ \square

5.1 Borel Cantelli lemmat

Lemma 5.1.1. (Borel-Cantelli I).

$$\sum_{n=1}^{\infty} P(A_n) < \infty \implies P(\limsup_n A_n) = P(\{\omega : \omega \in A_n \text{ äärettömään monille } n\text{:lle}\}) = 0$$

Tod.

$$\limsup_n A_n = \bigcap_n \bigcup_{k>n} A_k \subseteq \bigcup_{k>m} A_k \quad \forall m$$

Sarjan suppenemisesta seuraa

$$P(\limsup_n A_n) \leq \sum_{k>m} P(A_k) \rightarrow 0 \text{ kun } m \rightarrow \infty \quad \square$$

Lemma 5.1.2. Yleistetty Borel-Cantelli I (Barndorff-Nielsen, 1961)

Kun $\liminf_n P(A_n) = 0$ ja $\sum_{n=1}^{\infty} P(A_n \cap A_{n+1}^c) < \infty$, seuraa $P(\limsup_n A_n) = 0$.

Tod. Huomataan että

$$\limsup_n (A_n \cap A_{n+1}^c) = (\limsup_n A_n) \cap (\limsup_n A_n^c)$$

koska jos $(A_n \cap A_{n+1}^c)$ tapahtuu äärettömään usein, myös A_n ja A_n^c tapahtuvat äärettömään usein. Toisaalta, jos molemmat A_n ja A_n^c tapahtuvat äärettömään usein, myös $(A_n \cap A_{n+1}^c)$ tapahtuu äärettömään usein muuten jompikumpi $(\liminf_n A_n) = (\limsup_n A_n^c)^c$ tai $(\liminf_n A_n^c) = (\limsup_n A_n)^c$ tapahtuisi.

$$P(\limsup_n A_n) = P(\limsup_n (A_n \cap A_{n+1}^c)) + P((\limsup_n A_n) \cap (\limsup_n A_n^c)^c) = 0$$

koska oletuksesta ja ensimmäisen Borel Cantelli lemmasta seuraa

$$P(\limsup_n (A_n \cap A_{n+1}^c)) = 0,$$

ja $P((\limsup_n A_n^c)^c) = P(\liminf_n A_n) \leq \liminf_n P(A_n) = 0 \quad \square$.

Lause 5.1.1. (Kolmogorovin 0-1 laki) Todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}, P) olkoon $\{\mathcal{F}_k : k \in \mathbb{N}\}$ σ -algebroiden jono jossa $\mathcal{F}_k \subseteq \mathcal{F}$. Olkoon

$$\mathcal{F}^\infty = \bigvee_{k \in \mathbb{N}} \mathcal{F}_k, \quad \mathcal{T}_n = \bigvee_{k \geq n} \mathcal{F}_k, \quad \mathcal{T} = \bigcap_{n \in \mathbb{N}} \mathcal{T}_n$$

\mathcal{T} kutsutaan häntä (tail) σ -algebraksi.

Silloin kun σ -algebrat $\{\mathcal{F}_k : k \in \mathbb{N}\}$ ovat P -riippumattomia, eli

$$P(A_{k_1} \cap A_{k_2} \cap \dots \cap A_{k_n}) = \prod_{i=1}^n P(A_{k_i}) \quad \forall n, k_1, \dots, k_n \in \mathbb{N}, A_{k_i} \in \mathcal{F}_{k_i}.$$

seuraa että \mathcal{T} on P -triviaali, eli $P(A) \in \{0, 1\}$ kun $A \in \mathcal{T}$.

Tod. Olkoon $A \in \mathcal{T}$. Silloin $A \in \mathcal{T}_{n+1} \forall n \in \mathbb{N}$, ja tästä seuraa σ -algebroiden riippumattomuus

$$A \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} \left(\bigvee_{k=1}^n \mathcal{F}_k \right) \quad \forall n \implies A \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} \left(\bigvee_{k=1}^{\infty} \mathcal{F}_k \right) = \mathcal{F}^\infty$$

joka tarkoittaa $\mathcal{T} \stackrel{P}{\perp\!\!\!\perp} \mathcal{F}^\infty \supseteq \mathcal{T}$. Koska $A \in \mathcal{T}$ on P -riippumaton itsestään,

$$P(A) = P(A \cap A) = P(A)P(A).$$

Ainoat ratkaisut ovat $P(A) = 0, 1 \quad \square$

Esimerkki 5.1.1. Olkoon $(A_n : n \in \mathbb{N})$ tapahtumien jono jolla $A_n \in \mathcal{F}_n$. Osoitamme että $(\limsup_n A_n)$ kuuluu hanta- σ -algebralle \mathcal{T} . Olkoon $A := \limsup_n A_n = \bigcap_n B_n$ jossa $B_n = \bigcup_{k \geq n} A_k \supseteq \bigcup_{k \geq n+1} A_k \downarrow A$, ja $B_n \in \mathcal{T}_N \forall n \geq N$.

Koska B_n tapahtumat ovat sisäkkäisiä, $A = \bigcap_{n \geq 0} B_n = \bigcap_{n \geq N} B_n \in \mathcal{T}_N \forall N \in \mathbb{N}$, ja $A \in \bigcap_N \mathcal{T}_N = \mathcal{T}$.

Komplementtjoukkojen kautta seuraa myös että $\liminf_n A_n = (\limsup_n A_n^c)^c \in \mathcal{T}$

Lemma 5.1.3. (Borel-Cantelli II)

Olkoon $\{A_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{F}$ P -riippumattomien tapahtumien jono, eli

$$P(A_{i_1} \cap A_{i_2} \cap \dots \cap A_{i_n}) = \prod_{k=1}^n P(A_{i_k}) \quad \forall n, i_1, \dots, i_n \in \mathbb{N}.$$

Silloin

$$\sum_{n=1}^{\infty} P(A_n) = \infty \iff P(\limsup_n A_n) = P(\{\omega : \omega \in A_n \text{ äärettömään usein}\}) = 1$$

Tod. Olkoon $\mathcal{F}_n = \sigma(A_n) = \{A_n, A_n^c, \Omega, \emptyset\}$, $n \in \mathbb{N}$. Koska σ -algebrat $(\mathcal{F}_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ovat P -riippumattomia, ja tapahtuma $(\limsup_n A_n) \in \mathcal{T}$, se on P -triviaali, eli $P(\limsup_n A_n) \in \{0, 1\}$.

Kun $P(\limsup_n A_n) = 1$, ensimmäisen Borel Cantelli lemmasta seuraa $\sum_{n=1}^{\infty} P(A_n) = \infty$.

Kun $\sum_{n=1}^{\infty} P(A_n) = \infty$,

$$P((\limsup_n A_n)^c) = P(\liminf_n A_n^c) = P\left(\bigcup_n \bigcap_{k \geq n} A_k^c\right),$$

σ -additiivisuudesta ja epäyhtälöstä $(1-x) \leq \exp(-x)$ seuraa

$$\begin{aligned} P\left(\bigcap_{k \geq n} A_k^c\right) &= \lim_{N \uparrow \infty} P\left(\bigcap_{N \geq k \geq n} A_k^c\right) = \lim_{N \uparrow \infty} \prod_{N \geq k \geq n} (1 - P(A_k)) \leq \\ \lim_{N \uparrow \infty} \exp\left(-\sum_{k=n}^N P(A_k)\right) &= \exp\left(-\sum_{k=n}^{\infty} P(A_k)\right) = \exp(-\infty) = 0 \quad \forall n \in \mathbb{N}, \end{aligned}$$

josta seuraa $P((\limsup_n A_n)^c) = 0 \quad \square$

Huomautus 5.1.1. Toinen Borel Cantelli lemma ei päde suoraan ilman riippumattomuuden ehtoa. Esimerkiksi kun $A \in \mathcal{F}$ jolla $0 < P(A) < 1$ ja asetamme $A_n = A \quad \forall n \in \mathbb{N}$, $\sum_n P(A_n) = \infty$ mutta $P(\limsup_n A_n) = P(A) \notin \{0, 1\}$. Riippumattomuuden ehtoa voidaan kuitenkin heikentää.

Lemma 5.1.4. (Yleistetty Borel-Cantelli II)

Kun $\sum_{n=1}^{\infty} P(A_n) = \infty$ ja

$$\liminf_{n \rightarrow \infty} \frac{\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n P(A_i \cap A_j)}{\left(\sum_{i=1}^n P(A_i)\right)^2} = c < \infty$$

seuraa $P(\limsup A_n) \geq 1/c$.

Tod. Todistetaan myöhemmin Cauchy-Schwartzin epäyhtälön avulla.

Luku 6

Stokastinen konvergenssi

Määritelmä 6.0.1. Olkoon $X(\omega), X_n(\omega), n \in \mathbb{N}$ satunnaismuuttujat. Sanoetaan että jono (X_n) suppenee stokastisesti (tai todennäköisyyden mielessä) kohti X :aan, (merkintä: $X_n \xrightarrow{P} X$) kun jokaiselle $\varepsilon > 0$

$$P(\{\omega : |X_n(\omega) - X(\omega)| \geq \varepsilon\}) \rightarrow 0, \quad \text{kun } n \rightarrow \infty.$$

Stokastinen konvergenssi on heikompi kuin melkein varma konvergenssi:

Lause 6.0.2. 1. Kun $\lim_{n \rightarrow \infty} X_n(\omega) = X(\omega)$ P -melkein varmasti, myös $X_n \xrightarrow{P} X$.

2. Jos $X_n \xrightarrow{P} X$ (stokastisesti), on olemassa deterministinen alijono $\{n(k) : k \in \mathbb{N}\}$ jolla

$$\lim_{k \rightarrow \infty} X_{n(k)}(\omega) = X(\omega) \text{ } P\text{-melkein varmasti,}$$

3. $X_n \xrightarrow{P} X$ jos ja vain jos kaikille alijonoille $\{n(k)\}$ on olemassa alijonon (deterministinen) alijono $\{n(k_l)\}$ jolla $X_{n(k_l)}(\omega) \rightarrow X(\omega)$ P -melkein varmasti kun $l \rightarrow \infty$.

Tod. Voidaan olettaa että $X(\omega) = 0$, muuten otetaan $X_n(\omega) = X_n(\omega) - X(\omega)$.

1. $X_n(\omega) \rightarrow 0$ P -m.v. jos ja vain jos

$$P\left(\bigcap_n \bigcup_m \bigcap_{k \geq m} \{\omega : |X_k(\omega)| < n^{-1}\}\right) = 1$$

$$\iff \forall n \in \mathbb{N}, \quad P\left(\liminf_k \{\omega : |X_k(\omega)| < n^{-1}\}\right) = 1$$

Fatou lemmasta $\forall n$

$$1 = P\left(\liminf_k \{\omega : |X_k(\omega)| < n^{-1}\}\right) \leq \liminf_k P\left(\{\omega : |X_k(\omega)| < n^{-1}\}\right) = 1$$

$$\iff 0 = \limsup_k P\left(\{\omega : |X_k(\omega)| > n^{-1}\}\right) = \lim_k P\left(\{\omega : |X_k(\omega)| > n^{-1}\}\right)$$

2. Stokastisesta konvergenssista seuraa että on olemassa jono k_n jolla

$$P\left(\{\omega : |X_l(\omega)| > n^{-1}\}\right) < 2^{-n}, \quad \forall l \geq k_n$$

Koska

$$\sum_{n=1}^{\infty} P\left(\{\omega : |X_{k_n}(\omega)| > n^{-1}\}\right) < \sum_{n=1}^{\infty} 2^{-n} = 1 < \infty$$

Borel-Cantelli lemmasta (5.1.1) seuraa

$$0 = P\left(\limsup_n \{\omega : |X_{k_n}(\omega)| > n^{-1}\}\right)$$

$$\geq P\left(\limsup_n \{\omega : |X_{k_n}(\omega)| > N^{-1}\}\right) = 0 \quad \forall N \in \mathbb{N},$$

josta seuraa

$$1 = P\left(\bigcap_N \liminf_n \{\omega : |X_{k_n}(\omega)| \leq N^{-1}\}\right)$$

$$\iff X_{k_n}(\omega) \rightarrow 0 \quad P\text{-melkein varmasti.}$$

3. Olkoon $X(\omega) = 0$ ja tehdään vastaoletus että X_n ei suppenisi stokastisesti kohti nollaan: on olemassa $\varepsilon > 0$ ja jono $n(k) \uparrow \infty$ kun $k \uparrow \infty$ jolla

$$P(|X_{n(k)}| > \varepsilon) \geq \varepsilon > 0 \quad \forall k$$

Tästä tulee ristiriita koska oletetusti olisi olemassa alijono $n(k_l)$ jolla $X_{n(k_l)}(\omega) \rightarrow 0$ P -melkein varmasti ja siksi myös stokastisesti, siksi saadaan ristiriita

$$0 < \varepsilon \leq P(|X_{n(k_l)}| > \varepsilon) \rightarrow 0 \quad \text{kun } l \rightarrow \infty \quad \square$$

Huomautus: Kun X_n suppenee stokastisesti, jokaiselle alijonolle (n_k) löytyy alijonon alijono (n_{k_l}) ja joukko $N \subseteq \Omega$ jolla $P(N) = 0$, jolla $X_{n_{k_l}}(\omega) \rightarrow 0 \forall \omega \in N^c$. Yleisesti nolla-mittainen joukko N riippuu alijonosta (n_k) . Koska alijonojen joukko ei ole numeroituva, se ei tarkoita että olisi olemassa N jolla $P(N) = 0$, ja kaikille alijonolle (n_k) löytyisi alijonon alijono (n_{k_l}) jolla $X_{n_{k_l}}(\omega) \rightarrow 0 \forall \omega \in N^c$. Silloin $X_n(\omega)$ suppenisi P -melkein varmasti.

Lause 6.0.3. Jos $f : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ on jatkuva funktio ja $X_n(\omega), X(\omega) \in \mathbb{R}^d$ ovat satunnaisvektorit jolla

$$|X_n - X| \xrightarrow{P} 0 \quad \text{stokastisesti, kun } n \rightarrow \infty,$$

seuraa että

$$f(X_n) \xrightarrow{P} f(X) \quad \text{stokastisesti, kun } n \rightarrow \infty,$$

Todistus: Olkoon $(n_k : k \in \mathbb{N})$ mielivaltainen indeksijono. Karakterisaation (6.0.2.3) mukaan, on olemassa alijono $(n_{k(\ell)} : \ell \in \mathbb{N})$ jolla

$$X_{n_{k(\ell)}}(\omega) \rightarrow X(\omega) \quad P \text{ melkein varmasti kun } \ell \rightarrow \infty.$$

Koska f on jatkuva

$$f(X_{n_{k(\ell)}}(\omega)) \rightarrow f(X(\omega)) \quad P \text{ melkein varmasti kun } \ell \rightarrow \infty$$

ja väite seuraa karakterisaatiosta (6.0.2.3).

Esimerkki 6.0.2. Näytämme että stokastinen konvergenssi on aidosti heikompi kuin melkein varmaa konvergenssia: Olkoon $\Omega = (0, 1]$ varustettu Borel σ -algebralla $\mathcal{F} = \mathcal{B}((0, 1])$ tasaisella todennäköisyydellä, siis $P((0, t]) = t$, kun $t \in (0, 1]$.

Määritellään satunnaismuuttujen jono

$$X_{n,k}(\omega) = \mathbf{1}_{(k2^{-n}, (k+1)2^{-n})}(\omega) \quad k = 0, 1, \dots, (2^n - 1)$$

jossa indeksit voidaan järjestää seuraavaksi: $(n, k) \geq (m, h)$ jos ja vain jos $n > m$ tai $n = m$ ja $k \geq h$.

Seuraa että $\forall \omega \in (0, 1]$ kun $(n, k) \rightarrow \infty$ järjestyksen mukaisesti,

$$\liminf_{n,k \rightarrow \infty} X_{n,k}(\omega) = 0 \neq \limsup_{n,k \rightarrow \infty} X_{n,k}(\omega) = 1, \text{ ja}$$

$$P(\{\omega : X_{n,k} > 1/2\}) = P((k2^{-n}, (k+1)2^{-n}) = 2^{-n} \rightarrow 0 \text{ kun } n \rightarrow \infty.$$

Tehtävä 6.0.1. Etsi jonolle $(X_{n,k}(\omega), n \in \mathbb{N}, 0 \leq k \leq 2^n)$ alijono $(X_{n(l),k(l)} : l \in \mathbb{N})$ jolla $X_{n(l),k(l)}(\omega) \rightarrow 0$ P -m.v. kun $l \rightarrow \infty$.

Teoreema 6.0.1. Stokastisen konvergenssin topologia on metrinen.

$$X_n \xrightarrow{P} X \iff d(X, X_n) \rightarrow 0, \text{ jossa}$$

$$d(X, Y) = d(X - Y, 0) = E_P \left(\frac{|X - Y|}{1 + |X - Y|} \right) \text{ tai}$$

$$d(X, Y) = d(X - Y, 0) = E_P(1 \wedge |X - Y|)$$

Olkoon $X_n \xrightarrow{P} X = 0, \forall \varepsilon > 0,$

$$\frac{|X_n|}{(1 + |X_n|)} \leq \frac{|X_n|}{(1 + |X_n|)} \mathbf{1}(|X_n| > \varepsilon) + \varepsilon \mathbf{1}(|X_n| \leq \varepsilon) \leq \mathbf{1}(|X_n| > \varepsilon) + \varepsilon,$$

$$d(X_n, 0) \leq P(|X_n| > \varepsilon) + \varepsilon < 2\varepsilon$$

kun n on tarpeeksi suuri.

Toisinpäin, koska kuvaus $f(x) = x/(1+x)$ on aidosti kasvava x :n suhteen kun $x \geq 0$. ($f'(x) = (1+x)^{-2}$), $\forall \varepsilon > 0,$

$$\frac{\varepsilon}{1 + \varepsilon} \mathbf{1}(|X_n| > \varepsilon) \leq \frac{|X_n|}{1 + |X_n|} \mathbf{1}(|X_n| > \varepsilon) \leq \frac{|X_n|}{1 + |X_n|}$$

$$\frac{\varepsilon}{1 + \varepsilon} P(|X_n| > \varepsilon) \leq d(|X_n|, 0) \rightarrow 0 \text{ kun } n \rightarrow \infty$$

Näytämme että $d(X, Y)$ on etäisyys, se täyttää kolmion epäyhtälön:

$$\frac{|X - Y|}{1 + |X - Y|} \leq \frac{|X - Z| + |Z - Y|}{1 + |X - Z| + |Z - Y|} \leq \frac{|X - Z|}{1 + |X - Z|} + \frac{|Z - Y|}{1 + |Z - Y|}$$

kun otetaan odotusarvo seuraa $d(X, Y) \leq d(X, Z) + d(Z, Y)$ \square

6.1 Funktionaalianalyysin peruskäsitteiden pika-sanasto

1. Topologinen avaruus: (E, \mathcal{T}) jossa topologia $\mathcal{T} \subseteq 2^E$ on kaikkien avointen joukkojen kokoelma. Topologia on suljettu äärellisten leikkausten suhteen ja mielivaltaisten yhdistelmien suhteen. Avoimen joukon komplementti sanotaan suljetuksi.

Olkoon $\{x_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq E$. Sanotaan että $x_n \rightarrow x$ topologiassa \mathcal{T} jos

$\forall U \in \mathcal{T}$ jolle $x \in U, \exists n_U$ jolle $x_n \in U \forall n \geq n_U$.

2. $d : E \times E \rightarrow [0, +\infty]$ on metriikka jos

- $d(e, e') = 0$ jos ja vain jos $e = e'$
- $d(e, e') = d(e', e)$ (symmetrisyys)
- $d(e, e'') \leq d(e, e') + d(e', e'')$ (kolmion epäyhtälö)

3. Topologinen avaruus (E, \mathcal{T}) on metrinen jos on olemassa metriikka (etäisyys) $d : E \times E \rightarrow [0, +\infty]$, jonka suhteen avoimet pallot generoivat topologian \mathcal{T} :n, eli:

$$B(e, r) = \{e' : d(e, e') < r\} \in \mathcal{T} \forall e \in E, r > 0$$

ja kaikille $x \in U, x \in E, U \in \mathcal{T}$ on olemassa $r > 0$ jolle $x \in B(e, r) \subseteq U$.

Metrisessä avaruudessa, $\{x_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq E$ on *Cauchy jono* kun $\forall \varepsilon > 0$ on olemassa n_ε jolle $d(x_n, x_m) < \varepsilon$ kun $n, m \geq n_\varepsilon$.

Sanotaan että metrinen avaruus (E, d) on *täydellinen* jos kaikille Cauchy jonoille $\{x_n\}$ on olemassa rajaarvo $x \in E$.

4. Olkoon E reaalivektoriavaruus, eli kun $\lambda \in \mathbb{R}, x, y \in E$, myös $\lambda x \in E, (x + y) \in E$.

Kuvaus $\|\cdot\| : E \rightarrow [0, +\infty)$ on *normi* kun

$$\text{i) } \|x\| = 0 \in \mathbb{R} \iff x = \mathbf{0} \in E \quad \text{ii) } \|\lambda x\| = |\lambda| \|x\|$$

$$\text{iii) } \|x + y\| \leq \|x\| + \|y\|.$$

Kaikki normatut vektoriavaruuudet ovat metriset, metriikalla $d(x, y) := \|x - y\|$, joka generoi normi-konvergenssin topologian. Samalla avaruudella voi olla useita käyttökelpoisia topologioita.

5. esi-Hilbertin avaruus on normi-avaruus jossa normi on peräisin skalaaritulosta $\langle \cdot, \cdot \rangle$ jossa $\|x\|^2 := \langle x, x \rangle$. Reaaliarvoinen skalaaritulo on symmetrinen $\langle x, y \rangle = \langle y, x \rangle$, bilineaarinen $\langle \lambda x + \lambda' x', y \rangle = \lambda \langle x, y \rangle + \lambda' \langle x', y \rangle$, ja positiivinen $\langle x, x \rangle \geq 0$, jolla $\langle x, x \rangle = 0 \iff 0$.
6. Täydellinen normiavaruus on Banachin avaruus ja täydellinen esi-Hilbertin avaruus on Hilbertin avaruus.

Luku 7

Fubinin lause ja tulo-todennäköisyys

Lemma 7.0.1. *Olkoon $\{X_n\}_{n \in \mathbb{N}} \subseteq L^0(\Omega, \mathcal{F})$.*

1. *Kun $X_n(\omega) \geq 0$ P -melkein varmasti $\forall n$, seuraa*

$$\sum_{k=1}^{\infty} E_P(X_k) = E_P\left(\sum_{k=1}^{\infty} X_k(\omega)\right) \in [0, +\infty] \quad (7.0.1)$$

2. *Kun $(X_n)_{n \in \mathbb{N}} \subseteq L^1(P)$ (ei välttämättä ei-negatiivisia),*

ja $\sum_{k=1}^{\infty} E_P(|X_k|) < \infty$, satunnais-sarja

$$S_{\infty}(\omega) = \sum_{k=1}^{\infty} X_k(\omega)$$

suppenee P -melkein varmasti ja $L^1(P)$ -normissa, (7.0.1) on voimassa.

Todistus:

1. selvästi kun $X_n(\omega) \geq 0$, $S_n(\omega) := \sum_{k=1}^n X_k(\omega) \uparrow S_{\infty}(\omega) \in [0, +\infty]$ P -m.v. kun $n \uparrow \infty$, ja väite seuraa monotonisen konvergenssilauseesta.

2. Olkoon $Y_n = S_n(\omega) := \sum_{k=1}^n |X_k(\omega)|$, $Y_n \uparrow Y_{\infty} := \sum_{k=1}^{\infty} |X_k(\omega)|$ ja monotonisen konvergenssi lauseesta (4.1.1) seuraa

$$E_P(Y_{\infty}) = \sum_{k=1}^{\infty} E_P(|X_k|)$$

siis $Y_\infty \in L^1(P)$ ja erityisesti $P(Y_\infty < \infty) = 1$ P -melkein varmasti, ja P -m.v. $S_n(\omega) \rightarrow S_\infty(\omega)$ koska sarja suppenee absoluuttisesti.

Kolmio epäyhtälöstä seuraa

$$|S_n(\omega)| \leq Y_n(\omega) \uparrow Y_\infty(\omega) < \infty$$

jossa $Y_\infty \in L^1(P)$, dominoidun konvergenssi lauseesta (8.0.4) seuraa odotusarvojen sarjan konvergenssi $L^1(P)$ avaruudessa ja yhtälö (7.0.1) \square

Lemma 7.0.2. *Todennäköisyysavaruuksien $(\Omega_i, \mathcal{F}_i, P_i)$, $i=1,2$, tuloavaruus $\Omega_1 \times \Omega_2$ on varustettu tulo- σ -algebralla $\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2 := \sigma(\mathcal{F}_1 \times \mathcal{F}_2)$.*

Olkoon $X : (\Omega_1 \times \Omega_2, \mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ satunnaismuuttuja.

Silloin kaikille kiinnitetylle $\omega_2 \in \Omega_2$ kuvaus

$$\omega_1 \mapsto X(\omega_1, \omega_2)$$

on $(\Omega_1, \mathcal{F}_1) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ satunnaismuuttuja, ja tietysti myös kaikille kiinnitetylle $\omega_1 \in \Omega_1$ kuvaus

$$\omega_2 \mapsto X(\omega_1, \omega_2)$$

on $(\Omega_2, \mathcal{F}_2) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ satunnaismuuttuja. Myös päinvastainen implikaatio on tosi:

jos $\omega_1 \mapsto X(\omega_1, \omega_2)$ on \mathcal{F}_1 -mitallinen $\forall \omega_2 \in \Omega_2$, ja $\omega_2 \mapsto X(\omega_1, \omega_2)$ on \mathcal{F}_2 -mitallinen $\forall \omega_1 \in \Omega_1$,

seuraa että kuvaus $(\omega_1, \omega_2) \mapsto X(\omega_1, \omega_2)$ on $\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2$ -mitallinen.

Tod. Oletamme ensin että $|X(\omega_1, \omega_2)| \leq K$ jossa K on deterministinen. Olkoon

$\mathcal{C} = \{(\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)$ -mitalliset ja rajoitetut satunnaismuuttujat joilla väite on tosi $\}$

On selvää \mathcal{C} on monotoninen luokka ja

$$\mathbf{1}_{(A_1 \times A_2)}(\omega_1, \omega_2) = \mathbf{1}_{A_1}(\omega_1)\mathbf{1}_{A_2}(\omega_2) \in \mathcal{C}, \quad \forall A_i \in \mathcal{F}_i, i = 1, 2.$$

Koska $\mathcal{F}_1 \times \mathcal{F}_2$ on π -luokka, monotonisen luokan lauseesta seuraa että \mathcal{C} sisältää kaikki rajoitetut $(\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)$ -mitalliset kuvaukset.

Lause seuraa myös kun satunnaismuuttuja X ei ole rajoitettu, koska

$$\begin{aligned} X(\omega) &= \lim_{K \rightarrow \infty} X^{(K)}(\omega) \quad \forall \omega = (\omega_1, \omega_2) \in \Omega_1 \times \Omega_2 \quad \text{jossa} \\ X^{(K)}(\omega) &= X(\omega) \mathbf{1}(|X(\omega)| \leq K) \in [-K, K] \end{aligned}$$

jossa on osoitettu että $X^{(K)}(\omega_1, \cdot)$ on \mathcal{F}_2 -mitallinen $X^{(K)}(\cdot, \omega_2)$ on \mathcal{F}_1 -mitallinen.

Toiseen suuntaan, olkoon

$$\mathcal{C} = \left\{ \text{funktioit } X(\omega_1, \omega_2) \text{ jotka ovat rajoitettuja ja erikseen } \mathcal{F}_i\text{-mitallisia} \right\}$$

Seuraa että \mathcal{C} on monotoninen luokka, ja $\forall A_1 \in \mathcal{F}_1, A_2 \in \mathcal{F}_2 \mathbf{1}_{A_1}(\omega_1) \times \mathbf{1}_{A_2}(\omega_2) \in \mathcal{C}$. Monotonisen luokan lauseesta seuraa että \mathcal{C} sisältää kaikki rajoitetut ja $(\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)$ -mitalliset funktiot.

Teoreema 7.0.1. (*Fubinin lause*)

Olkoon $X : (\Omega_1 \times \Omega_2, \mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ satunnaismuuttuja.

- Kun $X(\omega_1, \omega_2) \geq 0$ määritellään marginaali-integraalit

$$I_1^X(\omega_1) = \int_{\Omega_2} X(\omega_1, \omega_2) P_2(d\omega_2), \quad I_2^X(\omega_2) = \int_{\Omega_1} X(\omega_1, \omega_2) P_1(d\omega_1)$$

(lemmasta 7.0.2 ja positiivisuudesta seuraa että nämä ovat hyvin määritellyitä).

Silloin iteroitu integraali ei riipu integroinnin järjestyksestä

$$\int_{\Omega_1} I_1^X(\omega_1) P_1(d\omega_1) = \int_{\Omega_1} \left\{ \int_{\Omega_2} X(\omega_1, \omega_2) P_2(d\omega_2) \right\} P_1(d\omega_1) = (7.0.2)$$

$$\begin{aligned} \int_{\Omega_2} I_2^X(\omega_2) P_2(d\omega_2) &= \int_{\Omega_2} \left\{ \int_{\Omega_1} X(\omega_1, \omega_2) P_1(d\omega_1) \right\} P_2(d\omega_2) := \\ &= \int_{\Omega_1 \times \Omega_2} X(\omega_1, \omega_2) (P_1 \otimes P_2)(d\omega_1 \times d\omega_2) \end{aligned}$$

ja tulotodennäköisyys $(P_1 \otimes P_2)(A)$ on hyvin määritetty kun $A \in (\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)$ ottaamalla $X(\omega_1, \omega_1) = \mathbf{1}_A(\omega_1, \omega_2)$.

- Yleisemmin kaava (7.0.2) on voimassa kun

$$\int_{\Omega_1 \times \Omega_2} |X(\omega_1, \omega_2)| (P_1 \otimes P_2)(d\omega_1 \times d\omega_2) < \infty$$

Todistus: määritellään

$\mathcal{C} = \{(\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)$ -mitalliset ja rajoitetut satunnaismuuttujat joilla väite on tosi $\}$

Osoitamme että \mathcal{C} on monotoninen luokka. Selvästi vakio $\mathbf{1} \in \mathcal{C}$ ja $(aX + bY) \in \mathcal{C}$ kun $X, Y \in \mathcal{C}$, $a, b \in \mathbb{R}$.

Olkoon jono $\{X^{(n)} : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{C}$ jolla

$$0 \leq X_n(\omega_1, \omega_2) \uparrow X(\omega_1, \omega_2) \leq K < \infty \quad \forall \omega_i \in \Omega_i, i = 1, 2.$$

Lemmasta 7.0.2 ja monotonisen konvergenssin lauseesta (4.1.1) seuraa

$$I_i^{X^{(n)}}(\omega_i) \uparrow I_i^X(\omega_i) \in L^0(\Omega_i, \mathcal{F}_i), \quad i = 1, 2.$$

Soveltamalla monotonisen konvergenssin lausetta toista kertaa seuraa

$$E_{P_1}(I_1^X) = \lim_{n \uparrow \infty} E_{P_1}(I_1^{X^{(n)}}) = \lim_{n \uparrow \infty} E_{P_2}(I_2^{X^{(n)}}) = E_{P_2}(I_2^X)$$

Fubinin lauseen väite pätee myös X :lle, siis $X \in \mathcal{C}$ joka on monotoninen luokka.

Selvästi $\mathbf{1}_{(A_1 \times A_2)} \in \mathcal{C} \quad \forall A_i \in \mathcal{F}_i, i = 1, 2.$

Koska $\mathcal{F}_1 \times \mathcal{F}_2$ on π -luokka, monotonisen luokan lauseesta seuraa että \mathcal{C} sisältää kaikki rajoitetut $(\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)$ -mitalliset kuvaukset. Erityisesti \mathcal{C} sisältää kaikki yksinkertaiset satunnaismuuttujat $X \in \mathcal{Y}(\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)$. Nyt monotonisen konvergenssi lauseen avulla väite seuraa myös kun $X \in (\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)^+$.

Osoitamme että kuvaus

$$(P_1 \otimes P_2) : (\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2) \longrightarrow [0, 1]$$

on σ -additiivinen todennäköisyys:

Olkoon $\{A^{(n)} : n \in \mathbb{N}\} \subseteq (\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)$ ei-vähenevä tapahtuma jono, siis

$$A^{(n)} \subseteq A^{(n+1)} \uparrow A = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} A^{(n)}$$

Määritellään joukkojen leikkeitä: kun $\omega_1 \in \Omega_1$,

$$A_2^{(n)}(\omega_1) := \{\omega_2 : (\omega_1, \omega_2) \in A^{(n)}\} \uparrow A_2(\omega_1) := \{\omega_2 : (\omega_1, \omega_2) \in A\} \text{ kun } n \uparrow \infty .$$

$\forall \omega_1 \in \Omega_1$, koska P_2 on σ -additiivinen seuraa $P_2(A_2^{(n)}(\omega_1)) \uparrow P_2(A_2(\omega_1))$, jossa $P_2(A_2^{(n)}(\omega_1))$ ja $P_2(A_2(\omega_1))$ ovat \mathcal{F}_1 -mitallisia satunnaismuuttujia. Nyt monotonisen konvergenssi lauseesta seuraa

$$(P_1 \otimes P_2)(A^{(n)}) = \int_{\Omega_1} P_2(A_2^{(n)}(\omega_1)) P_1(d\omega_1) \uparrow \int_{\Omega_1} P_2(A_2(\omega_1)) P_1(d\omega_1) = (P_1 \otimes P_2)(A) .$$

Hajottamalla $X(\omega) = (X^+(\omega) - X^-(\omega))$, odotusarvon linearisuudesta väite seuraa myös silloin kun $X \in L^1(\Omega_1 \times \Omega_2, \mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2, P_1 \otimes P_2)$ \square .

Seuraus 7.0.1. *Fubini lause on voimassa myös kun todennäköisyysavaruuDET $(\Omega_i, \mathcal{F}_i)$ varustetaan σ -äärellisillä mitoilla $\mu_i, i = 1, 2$.*

Tod. Kun mitat $\mu_i(d\omega_i)$ ovat äärellisiä, sovelletaan Fubini lauseen ensin todennäköisyysmitoille $P_i(d\omega_i) = \mu_i(d\omega_i)/\mu_i(\Omega_i)$ $i = 1, 2$.

Kun mitat μ_i ovat σ -äärellisiä on olemassa numeroituvia mitallisia osituksia

$$\Omega_i = \bigcup_{i \in \mathbb{N}} \Omega_i^{(n)}, \text{ jossa } (\Omega_i^{(n)} \cap \Omega_i^{(m)}) = \emptyset, n \neq m, \text{ ja } \mu_i(\Omega_i^{(n)}) < \infty \quad i = 1, 2$$

Väite seuraa kun integroidaan erikseen tulo-avaruuksissa $(\Omega_1^{(n)} \times \Omega_2^{(k)})$, $n, k \in \mathbb{N}$.

Seuraus 7.0.2. *Fubini lause yleistyy suoraan äärelliseen tuloavaruuteen*

$$(\Omega_1 \times \cdots \times \Omega_d, \mathcal{F}_1 \otimes \cdots \otimes \mathcal{F}_d, P_1 \otimes \cdots \otimes P_d), \quad d \in \mathbb{N}$$

Lause 7.0.1. *TodennäköisyysavaruuDESSA (Ω, \mathcal{F}, P) , olkoon*

$$X(\omega) = (X_1(\omega), X_2(\omega), \dots, X_d(\omega)) \in \mathbb{R}^d$$

satunnaisvektori, ja olkoon $P_X(dt)$ sen todennäköisyysjakauma $(\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$ avaruudessa:

$$P_X(B) = P(X^{-1}(B)) = P(\{\omega : X(\omega) \in B\}), \quad \text{kun } B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}^d)$$

Satunnaismuuttujat $X_1(\omega), \dots, X_d(\omega)$ ovat rippumattomia P -mitan suhteen jos ja vain jos vektorin todennäköisyysjakauma on koordinaattien jakaumien tulo:

$$P_X = (P_{X_1} \otimes \dots \otimes P_{X_d})$$

Tod. harjoitustehtävä.

Huomaat että kuten lemmassa 7.0.2 kuvaus $X : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$ on mitallinen jos ja vain jos koordinaatti-kuvaukset $X_i : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ $i = 1, \dots, d$ ovat mitallisia.

Esimerkki 7.0.1. Olkoon satunnaismuuttuja $X(\omega) \geq 0$ P -melkein varmasti. Silloin

$$E_P(X) = \int_{\Omega} X(\omega)P(d\omega) = \int_0^{\infty} t P_X(dt) = \int_0^{\infty} P(X > t)dt$$

Tod. koska $t = \int_0^{\infty} \mathbf{1}(s < t)ds$

$$\int_0^{\infty} t P_X(dt) = \int_0^{\infty} \left(\int_0^{\infty} \mathbf{1}(s < t)ds \right) P_X(dt)$$

Koska $\mathbf{1}(s < t) \geq 0$ ja Lebesguen mitta on σ -äärellinen, Fubini lause soveltuu. Vaihdamme integroinnin järjestyksen:

$$= \int_0^{\infty} \left(\int_0^{\infty} \mathbf{1}(s < t)P_X(dt) \right) ds = \int_0^{\infty} P_X((s, +\infty))ds = \int_0^{\infty} P(X > s)ds$$

7.0.1 Osittaisintegroinnin kaava

Lause 7.0.2. Olkoon $F, G : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ ei väheneviä ja oikealta jatkuvia funktioita. Silloin kun $a < b$,

$$\begin{aligned} \int_a^b G(x)F(dx) &= \int_a^b G(x-)F(dx) + \sum_{y \in (a,b]} \Delta G(y)\Delta F(y) \\ &= F(b)G(b) - F(a)G(a) - \int_a^b F(x-)G(dx) \end{aligned}$$

jossa integraalit ovat olemassa Riemann-Stieltjesin mielessä. Osittaisintegrointi kaava pätee myös kun $F(x) = F^+(x) - F^-(x)$, $G(x) = G^+(x) - G^-(x)$, jossa F^{\pm}, G^{\pm} ovat ei väheneviä ja oikealta jatkuvia.

Tod. Huomaamme ensin että

$$\int_a^b G(x)F(dx) = \int_{(a,b]} G(x)F(dx) = \int_{-\infty}^{\infty} \mathbf{1}_{(a,b]}(x)G(x)F(dx),$$

ja kun $x \geq a$,

$$G(x) = G(a) + \int_a^{\infty} \mathbf{1}(y \leq x)G(dy).$$

Tästä seuraa

$$\int_a^b G(x)F(dx) = \int_a^b \left\{ G(a) + \int_a^{\infty} \mathbf{1}(y \leq x)G(dy) \right\} F(dx) =$$

$$G(a)(F(b) - F(a)) + \int_a^b \left(\int_a^b \mathbf{1}(y \leq x)G(dy) \right) F(dx)$$

Koska mitat $F(dx)$ ja $G(dy)$ ovat äärelisiä kompakteissa ja integrandi on ei-negatiivinen, Fubinin lause soveltuu:

$$= G(a)(F(b) - F(a)) + \int_a^b \left(\int_a^b \mathbf{1}(y \leq x)F(dx) \right) G(dy) =$$

$$G(a)(F(b) - F(a)) + \int_a^b (F(b) - F(y-))G(dy) =$$

$$F(b)G(b) - F(a)G(a) - \int_a^b F(y-)G(dy).$$

Huomataan myös että voidaan kirjoittaa

$$\int_a^b G(x)F(dx) = \int_a^b G(x-)F(dx) + \sum_{y \in (a,b]} \Delta G(y)\Delta F(y)$$

koska ei-vähenevällä funktiolla on korkeintaan numeroituva määrä hyppyjä \square

Näytämme miten osittaisintegroitikaava toimii Gaussiselle jakaumalle.

Gaussinen osittaisintegrointi kaava

Lause 7.0.3. Olkoon $G(\omega)$ standardi Gaussinen satunnaismuuttuja jolla $E(G) = 0$ ja $E(G^2) = 1$, kertymäfunktioilla

$$\Phi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x \exp(-t^2/2) dt,$$

ja olkoon $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ absoluuttisesti jatkuva funktio jolla

$$f(x) = f(0) + \int_0^x f'(t) dt$$

jossa $f' : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ on Borel mitallinen ja (oletus)

$$E_P(|f'(G)|) < \infty$$

Silloin $E_P(|f(G)G|) < \infty$ ja seuraava Gaussinen osittaisintegrointikaava pätee

$$E_P(f'(G)) = E_P(f(G)G)$$

Todistus G :n jakauman tiheysfunktioille

$$\phi(x) = \frac{d\Phi}{dx}(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp(-x^2/2)$$

pätee

$$\phi'(x) = \frac{d\phi}{dx}(x) = -\phi(x)x.$$

Koska $E_P(|G|) < \infty$ (Gaussisella jakaumalla on äärellisiä eksponentiaalisia momenteja $E_P(\exp(\lambda G)) = \exp(\lambda^2/2) < \infty$ josta seuraa että $E_P(|G|^q) < \infty$, $\forall q > 0$), voidaan olettaa $f(0) = 0$. Fubini lauseesta seuraa

$$\begin{aligned} E_P(|f(G)G|) &= \int_{-\infty}^{\infty} |f(x)| |x| \Phi(dx) = \int_{-\infty}^{\infty} |f(x)| |x| \phi(x) dx \\ &\leq \int_{-\infty}^0 \left(\int_x^0 |f'(t)| dt \right) (-x) \phi(x) dx + \int_0^{\infty} \left(\int_0^x |f'(t)| dt \right) x \phi(x) dx \\ &= \int_{-\infty}^0 \left(\int_{-\infty}^t (-x) \phi(x) dx \right) |f'(t)| dt + \int_0^{\infty} \left(\int_x^{\infty} x \phi(x) dx \right) |f'(t)| dt \\ &\int_{-\infty}^{\infty} \phi(t) |f'(t)| dt = E_P(|f'(G)|) < \infty \end{aligned}$$

Siis Fubini lauseen integroituuvuden oletus on voimassa ja saa vaihtaa integroinnin järjestystä

$$\begin{aligned}
 E_P(f(G)G) &= \int_{-\infty}^{\infty} f(x) x \Phi(dx) = \int_{-\infty}^{\infty} f(x) x \phi(x) dx \\
 &= \int_{-\infty}^0 \left(\int_x^0 f'(t) dt \right) (-x) \phi(x) dx + \int_0^{\infty} \left(\int_0^x f'(t) dt \right) x \phi(x) dx \\
 &= \int_{-\infty}^0 \left(\int_{-\infty}^t (-x) \phi(x) dx \right) f'(t) dt + \int_0^{\infty} \left(\int_x^{\infty} x \phi(x) dx \right) f'(t) dt \\
 &= \int_{-\infty}^{\infty} \phi(t) f'(t) dt = E_P(f'(G)) < \infty \quad \square
 \end{aligned}$$

Huomautus 7.0.1. Gaussisesta osittaisintegrointi kaavasta saa paljon hyötyä ja Malliavin laskennassa se yleistyy myös ääretön-ulotteisille Gaussisille jakaumille.

7.0.2 Muuttujan vaihto-kaava eukliidisessä avaruudessa \mathbb{R}^d

Olkoon $f : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ differentoituva kuvaus, ja $\varphi : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ Borel mitallinen testi funktio. Osoitamme muuttujan vaihto kaavaa

$$\int_{\mathbb{R}^n} \varphi(f(x)) |\det(Jf(x))| dx = \int_{\mathbb{R}^n} \varphi(y) dy \quad (7.0.3)$$

jossa $Jf(x)$ on $n \times n$ Jacobiani-matriisi

$$Jf(x)_{ij} = \frac{\partial f_i}{\partial x_j}(x)$$

Huomataan että silloin kun $f(x) = Ax$ jossa A on kääntyvä $n \times n$ matriisi tulo-joukko

$$V = \Delta x_1 \times \times \cdots \times \Delta x_n$$

kuvautuu suuntaissärmiöksi AV jolla on särmät $A\Delta x_1, \dots, A\Delta x_n$.

Merkitään jatkossa

$$\Delta x_1 \wedge \cdots \wedge \Delta x_n = \det([\Delta x_1, \dots, \Delta x_n])$$

V :n tilavuus on

$$|V| = |\Delta x_1 \times \cdots \times \Delta x_n| = |\det([\Delta x_1, \dots, \Delta x_n])| = |\Delta x_1 \wedge \cdots \wedge \Delta x_n|$$

ja suuntaissärmiön AV :n tilavuus on

$$|AV| = |A\Delta x_1 \wedge \cdots \wedge A\Delta x_n| |\det([A\Delta x_1, \dots, A\Delta x_n])| = |\det(A)| |V|$$

Tässä lineaarisessa tapauksessa $Jf(x) = A$, eli jacobiaani on vakio.

Osoitetaan kaava (7.0.3) induktiolla. Kun $n = 1$,

testifunktiolle $\varphi(x)$ löytyy aina esitys

$$1 = \sum_{k=1}^{\infty} \psi_k(x)$$

jossa $\psi_k(x)$ ovat kompaktikantaisia, ja funktio kantajoukko on pieni joukko.

Siksi voidaan olettaa että testifunktiolle $\varphi(y)$ on kantajoukko on pieni väli I jossa derivaatan $f'(x)$ merkki ei muutu silloin kun $f(x) \in I$.

Esimerkki 7.0.2. Olkoon $\xi(\omega) = (\xi_1(\omega), \dots, \xi_d(\omega)) \in \mathbb{R}^d$ Gaussinen satunnaisvektori jonka komponentit $\xi_k(\omega) \in \mathbb{R}$ P -riippumattomia ja samoin jakautuneita standardi-Gaussisia satunnaismuuttujat, joilla $E_P(\xi_k) = 0$ ja $E_P(\xi_k^2) = 1$, $\mu = (\mu_1, \dots, \mu_d) \in \mathbb{R}^d$, vakio vektori, ja $A = (A_{ij} : 0 \leq i \leq j \leq d)$ vakio $d \times d$ matriisi.

Olkoon $X(\omega) = (\mu + A\xi(\omega))^T \in \mathbb{R}^d$. Silloin

- $E_P(X) = \mu$ ja $E_P(X_i X_j) - E_P(X_i)E_P(X_j) = \Sigma_{ij}$, jossa $\Sigma = AA^T$.
- satunnaisvektorilla X on tiheysfunktio \mathbb{R}^d -Lebesgue mitan suhteen

$$p_X(x) = (2\pi)^{-d/2} \det(\Sigma)^{-1/2} \exp\left(-\frac{1}{2}(x - \mu)\Sigma^{-1}(x - \mu)^T\right)$$

eli jos $g : \mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}$ on mitallinen rajoitettu testifunktio

$$\begin{aligned} E_P(g(X)) &= E_P(g(\mu + A\xi^T)) = \\ &= \int_{\mathbb{R}} \cdots \int_{\mathbb{R}} g\left(\mu_1 + \sum_{j=1}^d A_{1j}y_j, \dots, \mu_d + \sum_{j=1}^d A_{dj}y_j\right) \prod_{j=1}^d \left\{ \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp(-y_j^2/2) \right\} dy_1 \dots dy_d = \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} g(x_1, \dots, x_d) p_X(x_1, \dots, x_d) dx_1 \dots dx_d \end{aligned}$$

Solution

- Tiheys lasketaan muuttujan vaihdolla $x = \mu + Ay^\top$. Pystyvektorein

$$\xi(\omega) = (\xi_1(\omega), \dots, \xi_d(\omega))^\top \in \mathbb{R}^d$$

$$\mu = (\mu_1, \dots, \mu_d)^\top \in \mathbb{R}^d$$

$$x = (x_1, \dots, x_d)^\top \in \mathbb{R}^d$$

$$x = \mu + A\xi,$$

jne. Tiheyden neliömuotoon tulee $(x - \mu)^\top \Sigma^{-1}(x - \mu)$.

Muunnos on $\mathbb{R}^d \rightarrow \mathbb{R}^d$, oletetaan, että A on kääntyvä.

$$\begin{aligned} E_P(g(X)) &= E_{P_{\xi_1} \otimes \dots \otimes P_{\xi_d}}(g(X)) \stackrel{\text{II}}{=} \int_{\mathbb{R}} \dots \int_{\mathbb{R}} g(\mu + A\xi) dP_{\xi_1} \dots dP_{\xi_d} \\ &= \int_{\mathbb{R}^d} g(\mu + Ay) p_\xi(y) dy, \end{aligned} \quad (7.0.4)$$

missä

$$p_\xi(y) = \prod_{j=1}^d p_{\xi_j}(y_j) = (2\pi)^{-d/2} \exp \left\{ -\frac{1}{2} y^\top y \right\}$$

Sijoituksella $x = (\mu + Ay)$ yhtälöön (7.0.4) ($y = A^{-1}(x - \mu)$), Jakobiaani $= \det(A^{-1}) = (\det(A))^{-1}$ on

$$E_P(g(X)) = \int_{\mathbb{R}^d} g(x) \det(A^{-1}) p_\xi(A^{-1}(x - \mu)) dx := \int_{\mathbb{R}^d} g(x) p_X(x) dx,$$

ja

$$\begin{aligned} p_X(x) &= \det(A^{-1}) \exp \left\{ -\frac{1}{2} (A^{-1}(x - \mu))^\top (A^{-1}(x - \mu)) \right\} \\ &= \det(A^{-1}) \exp \left\{ -\frac{1}{2} (x - \mu)^\top (A^\top)^{-1} A^{-1} (x - \mu) \right\} \\ &= \det(A^{-1}) \exp \left\{ -\frac{1}{2} (x - \mu)^\top (AA^\top)^{-1} (x - \mu) \right\}. \end{aligned}$$

Asettamalla $\Sigma = AA^\top$ (symmetrinen positiivi definiitti oletuksin) on $\det(A) = \sqrt{\det(\Sigma)}$, saadaan multinormaalijakauma jolla on odotusarvo

$$E_P(X) = E_P(\mu + A\xi) = \mu + AE_P(\xi) = \mu.$$

ja kovarianssi matriisi

$$\begin{aligned} E(XX^\top) &= E((\mu + A\xi)(\mu + A\xi)^\top) = E(\mu\mu^\top + \mu\xi^\top A^\top + A\xi\mu^\top + A\xi\xi^\top A^\top) \\ &= \mu\mu^\top + AE(\xi\xi^\top)A^\top = \mu\mu^\top + AA^\top = \mu\mu^\top + \Sigma. \end{aligned}$$

Luku 8

Tasainen integroituvuus ja $L^1(P)$ -konvergenssi

Määritelmä 8.0.1. Merkitään

$$L^0(\Omega, \mathcal{F}, P) = \{ \mathbb{R}\text{-arvoiset satunnaismuuttujat todennäköisyysavaruudessa } (\Omega, \mathcal{F}, P) \}$$

jossa tarvittaessa identifioidaan X ja Y kun $X(\omega) = Y(\omega)$ P -melkein varmasti.

Kun $0 < p < \infty$, määritellään

$$L^p = L^p(\Omega, \mathcal{F}, P) = \{ X \in L^0(\Omega, \mathcal{F}, P) \text{ jolla } \|X\|_p < \infty \} \quad \text{jossa} \quad \|X\|_p = \{E_P(|X|^p)\}^{1/p}$$

Sanomme että $X_n \xrightarrow{L^p} X$ suppenee L^p -normissa kun $E_P(|X_n - X|^p) \rightarrow 0$ kun $n \rightarrow \infty$. Määritellään myös olennainen (essential) supremum

$$\|X\|_\infty = P\text{-esssup } \{|X(\omega)|\} := \inf \{y \in \mathbb{R} : |X(\omega)| \leq y \text{ } P\text{-melkein varmasti} \}$$

$$L^\infty = L^\infty(\Omega, \mathcal{F}, P) = \{X \in L^0(\Omega, \mathcal{F}, P) \text{ jolla } \|X\|_\infty < \infty\}$$

eli satunnaismuuttuja $X(\omega) \in L^\infty(P)$ jos ja vain jos on olemassa deterministinen $K < \infty$ jolla $|X(\omega)| \leq K$ P -melkein varmasti, ja s.m. on olennaisesti rajoitettu P -todennäköisyyden suhteen.

Osoitamme (myöhemmin) että $L^p(\Omega, \mathcal{F}, P)$ on Banachin avaruus (eli vektori avaruus jolla on täydellinen normi) kaikille $0 < p \leq +\infty$,

ja $L^2(\Omega, \mathcal{F}, P)$ on Hilbertin avaruus skalaaritulolla $\langle X, Y \rangle := E_P(XY)$.

106 LUKU 8. TASAINEN INTEGROITUVUUS JA $L^1(P)$ -KONVERGENSSI

Teoreema 8.0.2. Olkoon $0 < p \leq \infty$, ja $\lim_{n \rightarrow \infty} \|X_n\|_p = 0$. Seuraa että $X_n \xrightarrow{P} 0$.

Tod. Kun $0 < p < +\infty$, väite seuraa **Chebychevin epäyhtälöstä** : kun $\varepsilon > 0$,

$$\varepsilon^p P(|X_n| > \varepsilon) \leq E_P(|X_n|^p) \rightarrow 0 \text{ kun } n \rightarrow \infty .$$

Kun $p = +\infty, \forall K \in \mathbb{N} \exists \bar{n}$ jolla

$$P(\{\omega : |X_n(\omega)| \leq K^{-1}\}) = 1 \quad \text{kun } n \geq \bar{n}$$

josta seuraa että

$$P\left(\bigcap_{K \in \mathbb{N}} \bigcup_{m \in \mathbb{N}} \bigcap_{n > m} \{\omega : |X_n(\omega)| \leq K^{-1}\}\right) = P(\{\omega : X_n(\omega) \rightarrow 0\}) = 1$$

siis $X_n \rightarrow 0$ P -melkein varmasti ja myös stokastisesti \square

Lause 8.0.4. Lebesgue dominoidun konvegenssin lause L^p avaruudessa.

Olkoon $0 < p < \infty$, ja $(X_n(\omega) : n \in \mathbb{N}), X(\omega)$ satunnaismuuttujat jolla

- 1) $X_n \xrightarrow{P} X$ stokastisesti
- 2) $Y(\omega) := \sup_{n \in \mathbb{N}} |X_n(\omega)| \in L^p(\Omega, \mathcal{F}, P)$.

Silloin $X \in L^p(\Omega)$ ja $X_n \xrightarrow{L^p} X$.

Tod. On olemassa alijono $(n_k)_{k \in \mathbb{N}}$ jolla $\lim_{k \rightarrow \infty} X_{n_k}(\omega) = X(\omega)$ P -m.v.

Tästä seuraa $|X(\omega)| \leq Y(\omega)$ P -m.v. ja siksi $X \in L^p(\Omega, \mathcal{F}, P)$. Fubinin lauseesta

$$E_P(|X_n(\omega) - X(\omega)|^p) = \int_0^\infty P(|X_n - X|^p > t) dt .$$

Kolmion epäyhtälöstä seuraa

$$|X_n(\omega) - X(\omega)|^p \leq 2^p Y(\omega)^p \quad \text{ja siksi} \quad P(|X_n - X|^p > t) \leq P(Y^p > t 2^{-p})$$

jossa

$$\int_0^\infty P(2^p Y^p > t) dt = 2^p E_P(Y^p) < \infty$$

Määritellään funktioita

$$0 \leq f_n(t) := P(|X_n - X|^p > t) \leq g(t) := P(|Y|^p > t2^{-p}), \quad t \geq 0$$

Nämä funktiot ovat ei-kasvavia ja siksi mitallisia t :n suhteen. Jokaiselle $t > 0$

$$f_n(t) = P(|X_n - X|^p > t) \longrightarrow 0 \text{ kun } n \rightarrow \infty$$

koska $X_n \xrightarrow{P} X$ stokastisen konvergenssin mielessä. Koska yläraja $g(t)$ on integroitava Lebesgue mitan λ suhteen, Lebesguen dominoidun konvergenssin lause 4.1.2 astuu voimaan avaruudessa $(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}), \lambda)$, ja saadaan

$$\lim_{n \rightarrow \infty} E_P(|X_n - X|^p) = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^\infty f_n(t) dt = \int_0^\infty \left(\lim_{n \rightarrow \infty} f_n(t) \right) dt = 0 \quad \square$$

Huomautus: Koska

$$\begin{aligned} |E_P(X) - E_P(Y)| &= |E_P(X - Y)| = |E_P((X - Y)^+) - E_P((X - Y)^-)| \\ &\leq E_P((X - Y)^+) + E_P((X - Y)^-) = E_P(|X - Y|) \end{aligned}$$

kun $X_n \xrightarrow{L^1(P)} X$ seuraa $E_P(X_n) \rightarrow E_P(X)$.

Lebesguen dominoidun konvergenssin lauseen ehdot L^p -konvergenssille ovat riittäviä mutta ei välttämättömiä. Haluamme karakterisoida täydellisesti L^p -konvergenssia.

Käsitlemme ensin L^1 -konvergenssia. Olemme huomanneet (4.1.1) että ehdoista $X_n(\omega) \rightarrow X(\omega)$ P -melkein varmasti ja $X, X_n \in L^1(P)$ ei seuraa että $E(X_n) \rightarrow E(X)$, eikä myöskään $X_n \xrightarrow{L^1} X$. Siihen tarvitaan sen lisäksi seuraava kompaktisuuden kaltainen ehto:

Määritelmä 8.0.2. *Satunnaismuuttujien kokoelma $\mathcal{C} \subset L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$ on tasaisesti integroitava P :n suhteen, kun*

$$\lim_{K \rightarrow \infty} \sup_{X \in \mathcal{C}} E_P(|X| \mathbf{1}(|X| > K)) = \lim_{K \rightarrow \infty} \sup_{X \in \mathcal{C}} \int_{\{\omega: |X(\omega)| > K\}} |X(\omega)| P(d\omega) = 0$$

Lemma 8.0.3.

108LUKU 8. TASAINEN INTEGROITUVUUS JA $L^1(P)$ -KONVERGENSSI

1. Olkoon \mathcal{C} satunnaismuuttujien perhe. Jos perheelle on olemassa integroitava yläraja, eli

$$\sup_{X \in \mathcal{C}} |X(\omega)| \leq Y(\omega) \text{ } P \text{ melkein varmasti, jossa } Y \in L^1(P)$$

perhe on tasaisesti integroitava.

2. Äärellinen satunnaismuuttujien joukko $\mathcal{C} = \{X_1, X_2, \dots, X_M\} \subseteq L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$, $M \in \mathbb{N}$ on tasaisesti integroitava.

Tod. Kun

$$\sup_{X \in \mathcal{C}} |X(\omega)| \leq Y(\omega) \in L^1(P)$$

seuraa $\forall X \in \mathcal{C}$

$$|X(\omega)| \mathbf{1}(|X(\omega)| > K) \leq |Y(\omega)| \mathbf{1}(|Y(\omega)| > K)$$

josta seuraa

$$\sup_{X \in \mathcal{C}} E_P \left(|X(\omega)| \mathbf{1}(|X(\omega)| > K) \right) \leq E_P \left(|Y(\omega)| \mathbf{1}(|Y(\omega)| > K) \right) \downarrow 0 \text{ kun } K \uparrow \infty$$

Erityisesti kun $\mathcal{C} = \{X_1, \dots, X_n\} \subset L^1(P)$ on äärellinen joukko, se on tasaisesti integroitava koska löytyy integroitava yläraja:

$$|X_i(\omega)| \leq Y(\omega) := |X_1(\omega)| + \dots + |X_n(\omega)| \in L^1 \quad \square$$

Huomautus: Kun \mathcal{C} on ylinumeroituva, kuvaus

$$|X|^*(\omega) := \sup_{X \in \mathcal{C}} \{|X(\omega)|\}, \quad \omega \in \Omega$$

ei ole välttämättä satunnaismuuttuja, ja siksi joukko

$$A := \left\{ \omega : \sup_{X \in \mathcal{C}} |X(\omega)| \leq Y(\omega) \right\} = \bigcup_{X \in \mathcal{C}} \left\{ \omega : |X(\omega)| \leq Y(\omega) \right\}$$

ei ole välttämättä \mathcal{F} -mitallinen. Silti voidaan sanoa että $P(A) = 1$ jos on olemassa B jolla $P(B) = 1$ ja $A \subseteq B \in \mathcal{F}$. Silloin $A \in \mathcal{F}^P := \sigma(\mathcal{F}, \mathcal{N}^P)$ σ -algebraan joka on täydennetty P -nolla mittaisilla joukoilla.

Lause 8.0.5. (Tasaisen integroituvuuden karakterisaatio) $\mathcal{C} \subseteq L^1(P)$ on tasaisesti integroituva jos ja vain jos

$$\sup_{X \in \mathcal{C}} E_P(|X|) < \infty \quad \text{ja} \quad \forall \varepsilon > 0 \quad \exists \delta : P(A) < \delta \implies \sup_{X \in \mathcal{C}} E_P(|X| \mathbf{1}_A) < \varepsilon$$

Tod. Olkoon $\mathcal{C} \subseteq L^1(P)$ on tasaisesti integroituva.

$$\sup_{X \in \mathcal{C}} E(|X|) \leq M + \sup_{X \in \mathcal{C}} E_P(|X| \mathbf{1}(|X| > M)) < \infty$$

Tehdään vastaoletus: on olemassa tapahtumien jono $(A_k : k \in \mathbb{N})$ ja $\varepsilon > 0$ jolla $P(A_k) \leq 1/k$ ja

$$\sup_{X \in \mathcal{C}} E_P(|X| \mathbf{1}_{A_k}) \geq \varepsilon > 0$$

Koska

$$|X(\omega)| \mathbf{1}_{A_k} \leq M \mathbf{1}_{A_k}(\omega) + |X(\omega)| \mathbf{1}(|X(\omega)| > M) \quad \forall M \in \mathbb{N},$$

seuraa

$$\begin{aligned} 0 < \varepsilon &\leq \sup_{X \in \mathcal{C}} E(|X| \mathbf{1}_{A_k}) \leq MP(A_k) + \sup_{X \in \mathcal{C}} E_P(|X| \mathbf{1}(|X| > M)) \\ &\leq MP(A_k) + \varepsilon/3 \leq \varepsilon 2/3 \end{aligned}$$

kun valitaan M on tarpeeksi suureksi, ja $k \geq 3M/\varepsilon$.

Toisinpäin, jos

$$\sup_{X \in \mathcal{C}} E_P(|X|) = M < \infty,$$

Chebychevin epäyhtälön avulla seuraa $\forall X \in \mathcal{C}, k \in \mathbb{N}$

$$P(|X| > k) \leq M/k$$

Oletuksen mukaan $\forall \varepsilon > 0$ on olemassa δ jolla

$$E_P(|X| \mathbf{1}_A) < \varepsilon, \quad \forall X \in \mathcal{C}, \quad \forall A \text{ jolla } P(A) < \delta.$$

Kun $k \geq M/\delta$, seuraa $P(|X| > k) < \delta \quad \forall X \in \mathcal{C}$, ja

$$E_P(|X| \mathbf{1}(|X| > k)) < \varepsilon, \quad \forall X \in \mathcal{C} \quad \square$$

110LUKU 8. TASAINEN INTEGROITUVUUS JA $L^1(P)$ -KONVERGENSSI

Seuraus 8.0.3. $X \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$, jos ja vain jos $\forall \varepsilon > 0$ on olemassa δ , jolla kun $A \in \mathcal{F}$,

$$P(A) < \delta \implies E_P(|X| \mathbf{1}_A) < \varepsilon$$

Lemma 8.0.4. Olkoon satunnaismuuttujien jonot $(X_n : n \in \mathbb{N}) \subseteq L^1(P)$ ja $(Y_n : n \in \mathbb{N}) \subseteq L^1(P)$ tasaisesti integroituvia.

Silloin myös summien jono $(X_n + Y_n : n \in \mathbb{N})$ on tasaisesti integroituva.

Tod. Huomataan että $\forall K > 0$,

$$\begin{aligned} \{\omega : |X_n(\omega) + Y_n(\omega)| > K\} &\subseteq \{\omega : |X_n(\omega)| + |Y_n(\omega)| > K\} \\ &\subseteq \{\omega : |X_n(\omega)| > K/2\} \cup \{\omega : |Y_n(\omega)| > K/2\}, \end{aligned}$$

Siksi

$$\begin{aligned} E_P\left(|X_n + Y_n| \mathbf{1}(|X_n + Y_n| > K)\right) &\leq \\ &\leq E_P\left(|X_n + Y_n| \mathbf{1}(|X_n| > K/2)\right) + E_P\left(|X_n + Y_n| \mathbf{1}(|Y_n| > K/2)\right) \\ &\leq E_P\left(|X_n| \mathbf{1}(|X_n| > K/2)\right) + E_P\left(|Y_n| \mathbf{1}(|Y_n| > K/2)\right) \\ &\quad + E_P\left(|X_n| \mathbf{1}(|Y_n| > K/2)\right) + E_P\left(|Y_n| \mathbf{1}(|X_n| > K/2)\right) \end{aligned}$$

Koska satunnaismuuttujien jonot (X_n) ja (Y_n) ovat tasaisesti integroituvia, väite seuraa kun osoitamme

$$\lim_{K \rightarrow \infty} \sup_{n \in \mathbb{N}} E_P\left(|X_n| \mathbf{1}(|Y_n| > K/2)\right) = 0 \quad (8.0.1)$$

Koska (X_n) on tasaisesti integroituva, tasaisen integroituvuuden karakterisaatiosta (8.0.5) seuraa että $\forall \varepsilon > 0$ on olemassa δ jolla

$$P(A) < \delta \implies \sup_n E_P(|X_n| \mathbf{1}_A) < \varepsilon$$

Koska (Y_n) on tasaisesti integroituva, on olemassa K jolla

$$\sup_n P(|Y_n| > K/2) \leq \frac{2}{K} \sup_n E_P\left(|Y_n| \mathbf{1}(|Y_n| > K/2)\right) < \delta$$

josta seuraa väite 8.0.1 \square

Teoreema 8.0.3. ($L^1(P)$ -konvergenssin karakterisaatio) Olkoon satunnaismuuttujat $\{X_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$, $n \in \mathbb{N}$ ja $X \in L^0(\Omega, \mathcal{F})$. Silloin

1. $X_n \xrightarrow{P} X$ ja satunnaismuuttujen jono $\{X_n : n \in \mathbb{N}\}$ on tasaisesti integroitava,

jos ja vain jos

2. $X_n \xrightarrow{L^1} X \in L^1(P)$, eli

Tod. Kun $X_n \xrightarrow{P} X$ lauseesta (6.0.2) seuraa että on olemassa deterministinen indeksien alijono $n(k)$ jolle $X_{n(k)}(\omega) \rightarrow X(\omega)$ P -melkein varmasti.

Soveltamalla Fatoun lemmaa (4.1.4)

$$E_P(|X|) = E_P(\liminf_k |X_{n(k)}|) \leq \liminf_k E_P(|X_{n(k)}|) < \infty$$

jossa tasaisen integroitavuuden oletuksesta

$$\sup_{k \in \mathbb{N}} E_P(|X_{n(k)}|) \leq M + \sup_{k \in \mathbb{N}} E_P\left(|X_{n(k)}| \mathbf{1}(|X_{n(k)}| > M)\right) < \infty$$

Siis on osoitettu että $X \in L^1(P)$. Kun $K > 0$

$$\begin{aligned} E_P(|X_n - X|) &= E_P\left(|X_n - X| \mathbf{1}(|X_n - X| \leq K)\right) + E_P\left(|X_n - X| \mathbf{1}(|X_n - X| > K)\right) \\ &= \int_0^K P(|X_n - X| > t) dt - KP(|X_n - X| > K) + E_P\left(|X_n - X| \mathbf{1}(|X_n - X| > K)\right) \\ &\leq \int_0^K P(|X_n - X| > t) dt + E_P\left(|X_n - X| \mathbf{1}(|X_n - X| > K)\right), \end{aligned}$$

jossa käytettiin Fubini lauseetta:

$$\begin{aligned} E_P\left(|X_n - X| \mathbf{1}(|X_n - X| \leq K)\right) &= \int_0^\infty P\left(|X_n - X| \mathbf{1}(|X_n - X| \leq K) > t\right) dt \\ &= \int_0^K P\left(|X_n - X| \mathbf{1}(|X_n - X| \leq K) > t\right) dt = \int_0^K P(t < |X_n - X| \leq K) dt \\ &= \int_0^K P(|X_n - X| > t) dt - \int_0^K P(|X_n - X| > K) dt \\ &= \int_0^K P(|X_n - X| > t) dt - KP(|X_n - X| > K). \end{aligned}$$

112 LUKU 8. TASAINEN INTEGROITUVUUS JA $L^1(P)$ -KONVERGENSSI

Koska jono $(X_n : n \in \mathbb{N})$ on tasaisesti integroituva ja $X \in L^1(P)$, lemmasta (8.0.4) seuraa että jono $(|X_n - X| : n \in \mathbb{N})$ on tasaisesti integroituva, eli $\forall \varepsilon \exists K$ jolla

$$\sup_n E_P \left(|X_n - X| \mathbf{1}(|X_n - X| > K) \right) < \varepsilon$$

Koska $P(|X_n - X| > t)$ on rajoitettu, ja oletetusti $\lim_{n \rightarrow \infty} P(|X_n - X| > t) = 0$ $\forall t > 0$, Lebesgue dominoidun konvergenssin lauseesta seuraa

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^K P(|X_n - X| > t) dt = 0$$

eli on olemassa N jolla $\forall n \geq N$

$$\int_0^K P(|X_n - X| > t) dt < \varepsilon$$

josta seuraa $\forall n \geq N$

$$E_P(|X_n - X|) \leq \int_0^K P(|X_n - X| > t) dt + \sup_n E_P \left(|X_n - X| \mathbf{1}(|X_n - X| > K) \right) \leq 2\varepsilon.$$

Toisinpäin, (kts. lause 8.0.2)

$$E_P(|X_n - X|) \rightarrow 0 \implies X_n \xrightarrow{P} X.$$

Koska $X_n = X + (X_n - X)$, jossa oletetusti $X \in L^1(P)$, lemmän (8.0.4) nojalla meidän riittää todistaa että satunnaismuuttujen kokoelma

$$\{|X_n - X| : n \in \mathbb{N}\}$$

on tasaisesti integroituva. Voidaan olettaa samantien $X = 0$.

Olkoon $\varepsilon > 0$ ja N jolla $\forall n > N$

$$E_P(|X_n|) < \varepsilon$$

Koska $\{X_1, \dots, X_N\} \subset L^1(P)$ on äärellinen joukko, se on tasaisesti integroituva, ja on olemassa K jolla

$$\sup_{1 \leq n \leq N} E_P(|X_n| \mathbf{1}(|X_n| > K)) < \varepsilon$$

Mutta samalle K pätee myös $\forall n \geq N$

$$E_P(|X_n| \mathbf{1}(|X_n| > K)) \leq E_P(|X_n|) < \varepsilon$$

ja siksi

$$\sup_{n \in \mathbb{N}} E_P(|X_n| \mathbf{1}(|X_n| > K)) < \varepsilon \quad \square$$

Voidaan osoittaa että tasainen integroituvuus vastaa kompaktisuuden ehtoa $L^1(P)$ avaruudessa varustettuna heikolla topologiolla. Tämä ei päde vahvemmalle $L^1(P)$ -normin topologialle.

Teoreema 8.0.4. (Dunford-Pettisin lause) Satunnaismuuttujen joukko $\mathcal{C} \subseteq L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$ on tasaisesti integroituva P -mitan suhteen jos ja vain jos on esi-kompakti (precompact) $L^1(P)$ avaruuden heikossa topologiassa: kaikille jonolle $\{X_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{C}$ on olemassa indeksien jono $\{n(k) : k \in \mathbb{N}\}$ ja s.m. $X \in L^1(P)$ joilla

$$\lim_{k \rightarrow \infty} E_P((X_{n(k)} - X) \mathbf{1}_A) = 0 \quad \forall A \in \mathcal{F}$$

Huomautus 8.0.2. Tästä ei seura alijonon vahvempi L^1 -konvergenssi

$$E_P(|X_{n(k)} - X|) \rightarrow 0 .$$

Esimerkki 8.0.3. Olkoon $G(\omega)$ standardi gaussinen satunnaismuuttuja, jolla

$$P(G \leq x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x \exp(-y^2/2) dy$$

Määritellään satunnaismuuttujen jono

$$Z_n(\omega) = \exp(\sqrt{n}G(\omega) - n/2) > 0, \quad n \in \mathbb{N}.$$

Huomataan että

$$z_t(x) = \exp(xt - t^2/2) = \frac{\phi(x-t)}{\phi(x)} = \frac{dP_{G+t}}{dP_G}(x), \quad \text{jossa}$$

$$\phi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{x^2}{2}\right) \text{ on } G\text{:jakauman tiheysfunktio,}$$

on satunnaismuuttjen $(G+t)$ ja G :n jakaumien välinen uskottavuusosamäärä (Radon Nikodym derivaatta), ja $Z_n(\omega) = z_{\sqrt{n}}(G(\omega))$.

114LUKU 8. TASAINEN INTEGROITUVUUS JA $L^1(P)$ -KONVERGENSSI

Koska Gaussisen jakauman momentti-generoiva funktio on $E_P(\exp(tG)) = \exp(t^2/2)$, $\forall t \in \mathbb{R}$, seuraa $E_P(Z_n) = 1 \ \forall n \in \mathbb{N}$.

Osoitan että $\lim_{n \rightarrow \infty} Z_n(\omega) = 0$ P -melkein varmasti. Siitä seuraa että satunnaismuuttujien perhe $(Z_n : n \in \mathbb{N}) \subset L^1(P)$ ei ole tasaisesti integroituva, koska $E_P(Z_n) = 1 \not\rightarrow 0$.

Chebychevin epäyhtälön avulla, $\forall \alpha \in \mathbb{R}$,

$$P(Z_n > \varepsilon) \leq \varepsilon^{-\alpha} E_P(Z_n^\alpha) = \varepsilon^{-\alpha} E_P\left(\exp(\alpha\sqrt{n}G - \alpha n/2)\right) = \varepsilon^{-\alpha} \exp(-(1-\alpha)\alpha n/2)$$

kun $\alpha \in (0, 1)$,

$$P(Z_n > K^{-1}) \leq K^\alpha \beta^n$$

jossa $\beta = \exp((1-\alpha)\alpha/2) \in (0, 1)$.

Koska geometrinen sarja $\sum_{n=0}^{\infty} \beta^n = (1-\beta)^{-1} < \infty$ suppenee, ensimmäisestä Borel Cantelli lemmasta (5.1.1) seuraa $\forall K \in \mathbb{N}$

$$P\left(\limsup_n \{Z_n > K^{-1}\}\right) = 0$$

ja ottaamalla numeroituvan leikkauksen komplementtijoukoista

$$P\left(\bigcap_{K \in \mathbb{N}} \bigcup_{m \in \mathbb{N}} \bigcap_{n \geq m} \{Z_n \leq K^{-1}\}\right) = 1$$

eli $Z_n(\omega) \rightarrow 0$ P -melkein varmasti \square

Huomautus 8.0.3. Siis ääretönulotteisessa $L^1(P)$ avaruudessa rajoitettu joukko ei tarvitse olla tasaisesti integroituva, eli esi-kompakti heikon topologian suhteen. Funktionaali analyysin Banach-Alaogluin lause sanoo että suljettu yksikköpallo on kompakti niin sanotun heikko-tähti (weak star) topologian suhteen.

Huomautus 8.0.4. Satunnaismuuttujien kokoelman tasainen integroituuvuus koskee pelkästään satunnaismuuttujien jakaumat, niiden välinen riippuvuusrakenteella ei ole yhtään roolia.

Teoreema 8.0.5. (Leskelän ja Viholan tasaisen integroituvuuden karakterisointi, 2011) Satunnaismuuttujien kokoelma \mathcal{C} on tasaisesti integroituva jos ja vain jos on olemassa $0 \leq Y(\omega) \in L^1(P)$ jolla $\forall K > 0$

$$\sup_{X \in \mathcal{C}} E_P \left((|X| - K)^+ \right) \leq E_P \left((Y - K)^+ \right)$$

jossa $x^+ = x \vee 0 = x \mathbf{1}(x > 0)$.

Tod. (Todistamme nyt \Leftarrow implikaation, todistamme \Rightarrow myöhemmin, kun konveksisuuden määritelmät ovat käytössä).

Käytämme epäyhtälöä

$$x \mathbf{1}(x > K) \leq 2(x - K/2)^+, \quad K \geq 0$$

Seuraa

$$\sup_{X \in \mathcal{C}} E_P (|X| \mathbf{1}(|X| > K)) \leq 2 \sup_{X \in \mathcal{C}} E_P ((|X| - K/2)^+) \leq 2E_P ((Y - K/2)^+) \rightarrow 0$$

kun $K \rightarrow \infty$, jossa dominoidun konvergenssi lauseen oletukset ovat voimassa:

$Y(\omega) \geq (Y(\omega) - K/2)^+ \geq 0$ jossa $(Y(\omega) - K/2)^+ \rightarrow 0$ P -melkein varmasti kun $K \rightarrow \infty$, ja yläraja $Y(\omega)$ on integroituva \square

Huomautus 8.0.5. Kun satunnaismuuttujan $Y(\omega) \geq 0$ tulkitaan osakkeen markkinaarvoksi ja $K > 0$ on deterministinen, satunnaismuuttuja $(Y(\omega) - K)^+$ kutsutaan eurooppalaiseksi osto-optioksi lunastushinnalla K . Option haltijalla on oikeus mutta ei velvollisuutta ostaa yhden osakkeen ennalta sovitulla hinnalla K . Option haltijan kannattaa käyttää optionsa kun osakkeen markkinahinta on suurempi kun ennalta sovittu lunastushinta, saadakseen voittonsa $(Y(\omega) - K)^+$. Kun markkinahinta on pienempi tai yhtä kuin lunastushinta, optio on arvoton.

8.0.3 Sovellus: odotusarvon derivointi parametrin suhteen

Lemma 8.0.5. Olkoon $X_i : (\Omega_i, \mathcal{F}_i) \rightarrow (\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}))$ $i = 1, 2$ reaaliarvoisia satunnaismuuttujia eri todennäköisyysavaruuksissa. Silloin tulo $X(\omega_1, \omega_2) = X_1(\omega_1)X_2(\omega_2)$ on satunnaismuuttuja tuloavaruudessa $(\Omega_1 \times \Omega_2, \mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2)$.

116 LUKU 8. TASAINEN INTEGROITUVUUS JA $L^1(P)$ -KONVERGENSSI

Tod. Olkoon $X_i(\omega_i) \geq 0 \forall \omega_i \in \Omega_i, i = 1, 2$

(yleisemmin voidaan ensin hajottaa $X_i = (X_i^+ - X_i^-)$). Kun $t \geq 0$

$$\begin{aligned} & \{(\omega_1, \omega_2) : X_1(\omega_1)X_2(\omega_2) \leq t\} = \\ & \bigcup_{0 < q \in \mathbb{Q}} \left(\left\{ \omega_1 : X_1(\omega_1) \leq \frac{t}{q} \right\} \cap \left\{ \omega_2 : X_2(\omega_2) \leq q \right\} \right) \in (\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2) \quad , \end{aligned}$$

ja Dynkinin lemmasta (1.1.3) seuraa

$$\{(\omega_1, \omega_2) : X_1(\omega_1)X_2(\omega_2) \in B\} \in (\mathcal{F}_1 \otimes \mathcal{F}_2) \quad \forall B \in \mathcal{B}(\mathbb{R}) \quad \square$$

Lause 8.0.6. Olkoon (Ω, \mathcal{F}, P) todennäköisyysavaruus jossa

$$\{Y(t, \omega) : t \in [a, b]\} \subseteq L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$$

on tasaisesti integroitava satunnaismuuttujen joukko, $a < b \in \mathbb{R}$. Oletamme sen lisäksi

- Kaikille $\omega \in \Omega$, kuvaus $t \mapsto Y(t, \omega)$ on jatkuva.
- Kaikille $t \in [a, b]$ kuvaus $\omega \mapsto Y(t, \omega)$ on \mathcal{F} -mitallinen.

Tästä seuraa

1. kuvaus $(t, \omega) \mapsto Y(t, \omega)$ on $(\mathcal{B}([a, b]) \otimes \mathcal{F}) \rightarrow \mathcal{B}(\mathbb{R})$ mitallinen.
2. kuvaus $t \mapsto E_P(Y(t))$ on jatkuva.
3. Satunnaiskuvauksen

$$X(t, \omega) := \int_a^t Y(s, \omega) ds, \quad t \in [a, b].$$

odotusarvo $E_P(X(t))$ on derivoitava kaikissa $t \in (a, b)$, jatkuvalla derivaatalla

$$\frac{d}{dt} E_P(X(t)) = E_P(Y(t)) = E_P\left(\frac{d}{dt} X(t)\right)$$

Tod. Määritellään tuloavaruudessa $[a, b] \times \Omega$ satunnaismuuttujien jono

$$Y^{(N)}(t, \omega) = \sum_{k=0}^{(N-1)} Y\left(a + (b-a)\frac{k}{N}, \omega\right) \mathbf{1}\left(a + (b-a)\frac{k}{N} < t \leq a + (b-a)\frac{(k+1)}{N}\right), N \in \mathbb{N}$$

Lemma (8.0.5) nojalla seuraa $Y^{(N)}$ on $(\mathcal{B}([a, b]) \otimes \mathcal{F})$ -mitallinen, ja jatkuvuudesta seuraa

$$\lim_{N \uparrow \infty} Y^{(N)}(t, \omega) = Y(t, \omega) \quad \forall \omega,$$

siksi $Y(t, \omega)$ on myös $(\mathcal{B}([a, b]) \otimes \mathcal{F})$ -mitallinen.

Koska $\lim_{s \rightarrow t} Y_s(\omega) = Y_t(\omega)$ ja tasaisen integroituvuuden oletuksesta, seuraa

$$|E_P(Y_t) - E_P(Y_s)| \leq E_P|Y_t - Y_s| \rightarrow 0 \quad \text{kun } s \rightarrow t.$$

Koska $\{Y_t : t \in [a, b]\}$ on tasaisesti integroituva, seuraa että $\{Y_t : t \in [a, b]\}$ on rajoitettu $L^1(P)$ normissa, eli

$$\sup_{t \in [a, b]} E_P(|Y_t|) < \infty,$$

ja siksi $|Y(t, \omega)| \in L^1([a, b] \times \Omega, \mathcal{B}([a, b]) \otimes \mathcal{F}, dt \otimes P(d\omega))$. Fubinin lause soveltuu

$$E_P(X_t) = E_P\left(\int_a^t Y(s) ds\right) = \int_{[a, b] \times \Omega} Y(s, \omega) (P(d\omega) \otimes ds) = \int_a^t E_P(Y(s)) ds$$

ja koska kuvaus $t \mapsto E_P(Y(t))$ on jatkuva, analyysin keskiarvon lauseesta

$$\begin{aligned} & \lim_{\Delta \rightarrow 0} \Delta^{-1} \{E_P(X_{t+\Delta}) - E_P(X_t)\} \\ &= \lim_{\Delta \rightarrow 0} \Delta^{-1} \int_t^{t+\Delta} E_P(Y(s)) ds = E_P(Y(t)) \quad \square \end{aligned}$$

Esimerkki 8.0.4. Olkoon satunnaismuuttuja $X(\omega) \in \mathbb{R}$, ja $a < 0 < b$ jolla

$$m_X(t) := E_P(\exp(tX)) < \infty, \quad \forall t \in [a, b].$$

Olkoon $a < -\varepsilon < 0 < \varepsilon < b$, ja x' yhtälön $x'/\log(x') = (b - \varepsilon)$ ratkaisu.

118LUKU 8. TASAINEN INTEGROITUVUUS JA $L^1(P)$ -KONVERGENSSI

Koska $x \exp(\varepsilon x) \leq \exp(bx)$ kun $x \geq x'$, seuraa

$$E_P(X^+ \exp(\varepsilon X)) \leq x' \exp(\varepsilon x') + E_P(\exp(bX)) < \infty$$

Vastaavasti, kun $x''/\log(x'') = -(a + \varepsilon)$, koska $x \exp(\varepsilon x) \leq \exp(-ax)$ kun $x \geq x''$, seuraa

$$E_P(X^- \exp(-\varepsilon X)) \leq x'' \exp(\varepsilon x'') + E_P(\exp(-aX)) < +\infty .$$

Tästä seuraa

$$|X(\omega)| \exp(tX(\omega)) \leq |X(\omega)| \left\{ \exp(\varepsilon X(\omega)) + \exp(-\varepsilon X(\omega)) \right\} \in L^1(P) \quad \forall t \in [-\varepsilon, \varepsilon]$$

ja kokoelma

$$\left\{ X(\omega) \exp(tX(\omega)) : t \in [-\varepsilon, \varepsilon] \right\} \subseteq L^1(P)$$

on tasaisesti integroitava ,

$$\frac{d}{dt} m_X(t) = E_P \left(\frac{d}{dt} \exp(tX) \right) = E_P(X \exp(tX)) \quad \forall t \in (-\varepsilon, \varepsilon).$$

Erityisesti pisteessä $t = 0$

$$\frac{d}{dt} m_X(0) = E_P(X) .$$

Koska eskponentiaali funktio kasvaa polynoomien nopeammin, $\forall n \in \mathbb{N}$, samoin seuraa satunnaismuuttujien joukon

$$\left\{ X^n(\omega) \exp(tX(\omega)) : t \in [-\varepsilon, \varepsilon] \right\} \subseteq L^1(P)$$

tasainen integroitavuus, ja

$$\frac{d^n}{dt^n} m_X(t) = E_P \left(\frac{d^n}{dt^n} \exp(tX) \right) = E_P(X^n \exp(tX)), \quad \forall t \in (-\varepsilon, \varepsilon).$$

Erityisesti pisteessä $t = 0$

$$\frac{d^n m_X}{dt^n}(0) = E_P(X^n) .$$

Kuvaus $m_X(t) = E_P(\exp(tX))$ kutsutaan momentti-generoivaksi funktioksi.

Esimerkki 8.0.5. (Esscherin muunnos)

Olkoon $\Theta = \{m_X(t) = E_P(\exp(tX)) < \infty\}$. Kun $t \in \Theta$ määritellään mitanvaihtokaavan kautta todennäköisyyksmitta

$$P^{(t)}(A) = \frac{E_P(\exp(tX)\mathbf{1}_A)}{m_X(t)}, \quad \forall A \in \mathcal{F}.$$

Kun on olemassa $\varepsilon > 0$ jolle $[t - \varepsilon, t + \varepsilon] \subseteq \Theta$, seuraa

$$E_{P^{(t)}}(X^n) = \frac{E_P(X^n \exp(tX))}{m_X(t)} = \frac{1}{m_X(t)} \frac{d^n m_X}{dx^n}(t), \text{ erityisesti}$$

$$E_{P^{(t)}}(X) = \frac{d}{dt} \log(m_X(t))$$

Tod. Kuten tapauksessa $t = 0$.

120LUKU 8. TASAINEN INTEGROITUVUUS JA $L^1(P)$ -KONVERGENSSI

Luku 9

$L^p(\Omega)$ avaruudet

9.0.4 Epäyhtälöt

Määritelmä 9.0.3. Olkoon V vektoriavaruus, esimerkiksi $V = \mathbb{R}^d$. Kuvaus $g : V \rightarrow \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$ on konvekksi kun

$$g(px + (1-p)y) \leq pg(x) + (1-p)g(y) \quad \forall x, y \in V, p \in [0, 1]$$

Lause 9.0.7. Kuvaus $g : V \rightarrow \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$ on konvekksi jos ja vain jos

$$\text{epi}(g) = \{ (x, r) \in V \times \mathbb{R} : r \geq g(x) \}$$

on konvekssi joukko, eli kun (x, r) ja $(x', r') \in \text{epi}(g)$, myös pisteiden konvekssi-kombinaatiolle pätee

$$(x, r)p + (x', r')(1-p) = (xp + x'(1-p), rp + r'(1-p)) \in \text{epi}(g), \quad \forall p \in [0, 1]$$

Lause 9.0.8. Olkoon $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ konvekssi funktio. Silloin g on jatkuva, ja jokaisessa pisteessä on olemassa derivaatat oikealta ja vasemmalta

$$\nabla g^-(t) = \lim_{r \uparrow t} \frac{g(r) - g(t)}{r - t} \leq \nabla g^+(t) = \lim_{r \downarrow t} \frac{g(r) - g(t)}{r - t}$$

ja $\nabla g^\pm(s) \leq \nabla g^\pm(t)$ kun $s \leq t$.

Tod. kun $t \leq s \leq r$,

$$\frac{g(s) - g(t)}{s - t} \leq \frac{g(r) - g(t)}{r - t}$$

koska kun $p = (r - s)/(r - t) \in [0, 1]$, $s = pt + (1 - p)r$, konveksisuudesta

$$g(s) - g(r) \leq (g(t) - g(r)) p$$

Tästä seuraa että jokaiselle t , jono

$$(g(t + n^{-1}) - g(t))n \quad n \in \mathbb{N}$$

ei kasva ja siksi monotoninen raja on olemassa. Koska oikea ja vasen derivaatat $\nabla^\pm g(t)$ ovat olemassa, $g(t)$ on jatkuva jokaisessa $t \in \mathbb{R}$. Konveksisuudesta seuraa myös

$$\frac{g(s) - g(t)}{s - t} \leq \frac{g(r) - g(s)}{r - s}$$

kun $t \leq s \leq r$, siksi $\nabla^+ g(t) \leq \nabla^- g(r)$ kun $t < r$ \square

Huomautus 9.0.6. Koska derivaatat ovat ei-väheneviä,

1. Joukko

$$D := \left\{ t : \nabla^+ g(t) > \nabla^- g(t) \right\}$$

on korkeintaan numeroituva.

2. jokaiselle $t \in \mathbb{R}$, $\delta \in [\nabla^- g(t), \nabla^+ g(t)]$

$$g(s) = g(t) + \int_t^s \nabla^\pm g(r) dr \geq g(t) + (s - t)\delta \quad \forall s$$

Seuraa myös että $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ on konvekksi jos ja vain jos on absoluuttisesti jatkuva Lebesgue mitan suhteen ja Radon-Nikodymin-derivaatta $\frac{dg}{dx}(x)$ on ei-vähenevä.

Lause 9.0.9. (Jensenin epäyhtälö) Olkoon $X(\omega) \in \mathbb{R}$ satunnaismuuttuja jolla $E_P(|X|) < \infty$ ja $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ konveksikuvaus. Silloin

$$g(E_P(X)) \leq E_P(g(X))$$

R. Koska g on konvekksi, sen oikea ja vasen derivaatat pisteessä $\mu = E_P(X)$ ovat olemassa. Kaikille $\delta \in [\nabla^- g(\mu), \nabla^+ g(\mu)]$

$$g(X(\omega)) \geq g(E_P(X)) + \delta\{X(\omega) - E_P(X(\omega))\}$$

ja väite seuraa ottaamalla odotusarvon \square

Huomautus Jensenin epäyhtälö on voimassa pelkästään kun integroidaan todennäköisyysmitan suhteen.

Lemma 9.0.6. *Kun $1 \leq p < r$, $L^p(\Omega, \mathcal{F}, P) \supseteq L^r(\Omega, \mathcal{F}, P)$.*

Tod. Olkoon $X \in L^r(P)$.

Kun $r = \infty$, $|X(\omega)|^p \leq \|X\|_\infty^p$ P -melkein varmasti ja väite seuraa.

Kun $r < \infty$, olkoon

$$Y_n(\omega) = n \wedge |X(\omega)|^p \in L^{r/p}(P) .$$

Koska $0 \leq Y_n(\omega) \leq n$ seuraa $Y_n(\omega) \in L^1(P)$.

Kuvaus $g : \mathbb{R}^+ \rightarrow \mathbb{R}^+$ jolla $x \mapsto g(x) = x^{r/p}$ on konvekksi. Jensenin epäyhtälöstä seuraa:

$$E_P(Y_n^{r/p}) \geq E_P(Y_n)^{r/p}$$

Monotonisen konvergenssi lauseesta, koska $0 \leq Y_n(\omega) \uparrow |X(\omega)|^p \forall \omega$ seuraa

$$E_P(|X|^r) \geq E_P(|X|^p)^{r/p}.$$

Emme olisi voineet soveltaa Jensenin epäyhtälöä suoraan satunnaismuuttujalle $|X(\omega)|^p$ koska apriori oli epäselvää kuuluuko $L^{r/p}(P)$ avaruuteen. Siksi käytettiin kätkeytyä muuttuja $\{Y_n\}$ \square

Huomautus 9.0.7. *Tässä on olennaista että P on todennäköisyysmitta tai äärellinen mitta, koska silloin kun $\nu(\Omega) = \infty$ $L^\infty(\Omega, \mathcal{F}, \nu) \not\subseteq L^1(\Omega, \mathcal{F}, \nu)$, ja pelkästään kätkeysemällä ei saadan integroituvia satunnaismuuttujia.*

Väite ei päde $L^p(\Omega, \mathcal{F}, \nu)$ avaruuksille silloin kun $\nu(\Omega) = \infty$.

Kun $\nu(\Omega) < \infty$ määritellään $P(A) = \nu(A)/\nu(\Omega)$ josta seuraa

$$\left\{ \int_\Omega |X(\omega)|^p \nu(d\omega) \right\}^{1/p} \leq \nu(\Omega)^{(r-p)/(rp)} \left\{ \int_\Omega |X(\omega)|^r \nu(d\omega) \right\}^{1/r}$$

siis $L^p(\Omega, \mathcal{F}, \nu) \supseteq L^r(\Omega, \mathcal{F}, \nu)$ myös tässä tapauksessa. Tämä epäyhtälö ei kerro meille mitään kun $\nu(\Omega) = \infty$.

Lause 9.0.10. (Cauchy Schwartzin epäyhtälö , $p = 2$)

Olkoon $X(\omega), Y(\omega) \in L^2(\Omega, \mathcal{F}, P)$ silloin

1. tulo $(X(\omega)Y(\omega)) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$ ja

$$\| XY \|_1 = E_P(|XY|) \leq \sqrt{E_P(X^2)}\sqrt{E_P(Y^2)} = \| X \|_2 \| Y \|_2$$

jossa yhtäsuuruisuus on voimassa jos ja vain jos $Y(\omega) = cX(\omega)$ P m.v. jollekin $c \in \mathbb{R}$. Kun $E_P(XY) = 0$ sanomme että satunnaismuuttujat ovat ortogonaaliisia.

2. Kolmion epäyhtälö on voimassa:

$$\| X + Y \|_2 \leq \| X \|_2 + \| Y \|_2$$

1. Tod. Olkoon

$$X_n(\omega) = n \wedge |X(\omega)|, \quad Y_n(\omega) = n \wedge |Y(\omega)|$$

koska $0 \leq X_n(\omega), Y_n(\omega) \leq n \forall \omega$, seuraa $(X_n(\omega)Y_n(\omega)) \in L^1(P)$.

$$\forall t \in \mathbb{R}, \quad 0 \leq \left(tX_n(\omega) + Y_n(\omega) \right)^2 = t^2 X_n(\omega)^2 + Y_n(\omega)^2 + 2tX_n(\omega)Y_n(\omega)$$

Ottaamalla odotusarvoa (joka on olemassa ainakin katkaistetuille satunnaismuuttujille), seuraa että toisen asteen yhtälöllä

$$t^2 E_P(X_n^2) + 2t E_P(X_n Y_n) + E(Y_n^2) = 0$$

on korkeintaan yksi reaaliratkaisu, josta seuraa

$$E_P(X_n Y_n)^2 - E(X_n^2)E(Y_n^2) \leq 0$$

Koska

$$0 \leq |X_n(\omega)Y_n(\omega)| \uparrow |X(\omega)Y(\omega)| \quad \forall \omega$$

seuraa monotonisen konvergenssin lauseesta

$$E_P(|XY|)^2 - E(X^2)E(Y^2) \leq 0$$

2. Tod.

$$\begin{aligned} E_P((X+Y)^2) &= E_P(X^2) + E_P(Y^2) + 2E_P(XY) \\ &\leq E_P(X^2) + E_P(Y^2) + 2E_P(|XY|) \\ &\leq E_P(X^2) + E_P(Y^2) + 2\sqrt{E_P(X^2)}\sqrt{E_P(Y^2)} = \left\{ \sqrt{E_P(X^2)} + \sqrt{E_P(Y^2)} \right\}^2 \quad \square \end{aligned}$$

Lause 9.0.11. Seuraavat identiteetit ovat voimassa $L^2(P)$ avaruudessa:

1. Kun $X, Y \in L^2(P)$, $\|X+Y\|_2^2 + \|X-Y\|_2^2 = 2\|X\|_2^2 + 2\|Y\|_2^2$
(Suunnikkaan identiteetti)

2. $E_P(XY) = \frac{1}{4}(\|X+Y\|_2^2 - \|X-Y\|_2^2)$ (Polarisaation identiteetti)

Todistus: harjoitustehtävä.

Huomautus Voidaan myös osoittaa että kun normi $\|x\|$ toteuttaa suunnikkaan identiteetti, on olemassa skalaari tulo (x, y) jolla $\|x\|^2 = (x, x)$.

Jensenin epäyhtälön avulla Cauchy-Schwarz epäyhtälö yleistyy $L^p(\Omega, \mathcal{F}, \mu)$ avaruuksiin, jossa $1 < p < \infty$ ja μ on yleinen positiivinen mitta.

Huomataan myös että kun $X \in L^1(\mu), Y \in L^\infty(\mu)$, koska

$$|X(\omega)Y(\omega)| \leq |X(\omega)| \|Y\|_\infty$$

seuraa suoraan että tulo $(XY) \in L^1(\mu)$.

Lause 9.0.12. Olkoon $X \in L^p(\Omega, \mathcal{F}, \mu)$ ja $Y \in L^q(\Omega, \mathcal{F}, \mu)$, $1 \leq p \leq \infty$
jossa $q = p/(p-1)$ on konjugattiekspONENTTI joka toteuttaa $(q^{-1} + p^{-1}) = 1$.
Silloin

$$\begin{aligned} \int_\Omega |X(\omega)Y(\omega)| \mu(d\omega) &\leq \left\{ \int_\Omega |X(\omega)|^p \mu(d\omega) \right\}^{1/p} \left\{ \int_\Omega |Y(\omega)|^q \mu(d\omega) \right\}^{1/q} \\ &= \|X\|_{L^p(\mu)} \|Y\|_{L^q(\mu)} \end{aligned}$$

(Hölderin epäyhtälö).

Kun $X, Y \in L^p(\Omega, \mathcal{F}, \mu)$, $1 \leq p \leq \infty$

$$\|X+Y\|_{L^p(\mu)} \leq \|X\|_{L^p(\mu)} + \|Y\|_{L^p(\mu)}$$

(Minkowskin epäyhtälö).

Tod. (Hölder) Olkoon $1 < p < \infty$. Tietenkin voidaan olettaa $X(\omega) \geq 0$
 $Y(\omega) \geq 0$ ja $E_P(|X|^p) > 0$, muuten $X(\omega) = 0$ P -m.v. ja epäyhtälö seuraa.

Määritellään satunnaismuuttuja

$$\tilde{Y}(\omega) := \frac{Y(\omega)}{X(\omega)^{p-1}} \mathbf{1}(X(\omega) > 0) \geq 0$$

ja todennäköisyysmitta

$$\tilde{P}(d\omega) = \frac{X(\omega)^p}{\|X\|_{L^p(\mu)}^p} \mu(d\omega)$$

Jensenin epäyhtälöstä

$$\{E_{\tilde{P}}(\tilde{Y})\}^q \leq E_{\tilde{P}}(\tilde{Y}^q)$$

kaikille $q \geq 1$ erityisesti kun $q = p/(p-1)$

$$\begin{aligned} & \left\{ \int_{\Omega} \frac{Y(\omega)}{X(\omega)^{p-1}} \mathbf{1}(X(\omega) > 0) \frac{X(\omega)^p}{\|X\|_{L^p(\mu)}^p} \mu(d\omega) \right\}^q \\ & \leq \int_{\Omega} \left\{ \frac{Y(\omega)}{X(\omega)^{p-1}} \mathbf{1}(X(\omega) > 0) \right\}^q \frac{X(\omega)^p}{\|X\|_{L^p(\mu)}^p} \mu(d\omega) \iff \\ & \|X\|_{L^p(\mu)}^{-pq} \left\{ \int_{\Omega} Y(\omega) X(\omega) \mu(d\omega) \right\}^q \leq \|X\|_{L^p(\mu)}^{-p} \int_{\Omega} Y(\omega)^q X(\omega)^{(q(p-1)-p)} \mu(d\omega) \end{aligned}$$

jossa $q(p-1) - p = 0$. Seuraa

$$\int_{\Omega} Y(\omega) X(\omega) \mu(d\omega) \leq \left\{ \int_{\Omega} Y(\omega)^q \mu(d\omega) \right\}^{1/q} \|X\|_{L^p(\mu)}^{(1-1/q)p}$$

jossa $(1-1/q)p = 1$.

Tod. (Minkowski) Huomataan ensin että $\forall x, y \geq 0$,

$$(x+y)^p \leq (2 \max(x, y))^p \leq 2^p(x^p + y^p),$$

siksi kun $X, Y \in L^p(\Omega, \mathcal{F}, \mu)$, myös $(X+Y) \in L^p(\mu)$. Seuraa Hölderin epäyhtälöstä

$$\begin{aligned} & \int_{\Omega} |X+Y|^p d\mu \leq \int_{\Omega} |X| |X+Y|^{p-1} d\mu + \int_{\Omega} |Y| |X+Y|^{p-1} d\mu \\ & \leq (\|X\|_{L^p(\mu)} + \|Y\|_{L^p(\mu)}) \| |X+Y|^{p-1} \|_{L^q(\mu)} \\ & = (\|X\|_{L^p(\mu)} + \|Y\|_{L^p(\mu)}) (\|X+Y\|_{L^p(\mu)})^{p/q} \end{aligned}$$

Tästä seuraa

$$\|X + Y\|_{L^p(\mu)}^{(1-1/q)p} \leq \|X\|_{L^p(\mu)} + \|Y\|_{L^p(\mu)}$$

jossa $(1 - 1/q)p = 1$ \square

Lause 9.0.13. $\forall 1 \leq p \leq \infty$, $L^p(\Omega, \mathcal{F}, P)$ on täydellinen :

jos $\{X_n(\omega)\} \in L^p(\Omega, \mathcal{F}, P)$ on Cauchy jono,

eli $\forall \varepsilon > 0 \exists N_\varepsilon$ jolle $\|X_n - X_m\|_{L^p(P)} < \varepsilon$ kun $n, m \geq N_\varepsilon$,

on olemassa $X_\infty(\omega) \in L^p(P)$ jolle $\lim_{n \uparrow \infty} \|X_n - X\|_{L^p(P)}$.

Tämä lause ja sen todistus pätevät myös silloin kun integroidaan positiivisen mitan $\mu(d\omega)$:n suhteen, jolla $\mu(\Omega) = +\infty$.

Tod. Tapaus jossa $p = \infty$ jää harjoitustehtäväksi.

Olkoon $p < \infty$ ja $\{X_n\} \subseteq L^p$ Cauchy jono. On olemassa jono (k_n) jolla

$$\|X_r - X_s\|_p \leq 2^{-n} \quad \forall r, s \geq k_n$$

Koska jono $(X_n - X_{k_0} : n \geq k_0)$ on myös Cauchy jono, voidaan unohtaa jonon alkuosaa ja olettaa $X_0(\omega) = 0$ ja $k_0 = 0$. Saadaan teleskooppinen esitys

$$X_{k_n}(\omega) = \sum_{m=1}^n (X_{k_m}(\omega) - X_{k_{m-1}}(\omega)).$$

Jokaiselle $\omega \in \Omega$, rakennetaan monotoninen jono

$$Y_n(\omega) := \sum_{m=1}^n |X_{k_m}(\omega) - X_{k_{m-1}}(\omega)| \uparrow Y_\infty(\omega) = \sum_{m=1}^{\infty} |X_{k_m}(\omega) - X_{k_{m-1}}(\omega)| \in [0, \infty]$$

Minkowskin epäyhtälöstä (9.0.1)

$$\|Y_n\|_{L^p} \leq \sum_{m=1}^n \|X_{k_m}(\omega) - X_{k_{m-1}}(\omega)\|_{L^p}$$

ja monotonisen konvergenssin lauseesta

$$\|Y_\infty\|_{L^p} \leq \sum_{m=1}^{\infty} \|X_{k_m}(\omega) - X_{k_{m-1}}(\omega)\|_{L^p} \leq \sum_{m=0}^{\infty} 2^{-m} = 2 < \infty$$

Tästä seuraa että P -melkein varmasti

$$Y_\infty(\omega) = \sum_{m=1}^{\infty} |X_{k_m}(\omega) - X_{k_{m-1}}(\omega)| < \infty,$$

josta seuraa että P -melkein varmasti sarja

$$X_\infty(\omega) = \sum_{m=1}^{\infty} (X_{k_m}(\omega) - X_{k_{m-1}}(\omega))$$

suppenee absoluuttisesti. Jotta $X_\infty(\omega)$ olisi määritelty kaikille ω :lle, olkoon

$$X_\infty(\omega) := \limsup_{n \rightarrow \infty} X_{k_n}(\omega), \quad \forall \omega \in \Omega$$

Seuraa että $X(\omega)$ on satunnaismuuttuja ja $X_{k_n}(\omega) \rightarrow X(\omega)$ P -melkein varmasti. Kun $r > k_n$ ja $\forall m > n$

$$\begin{aligned} E_P(|X_r - X_{k_m}|^p) &\leq 2^{-np} \quad \implies \\ E_P(|X_r - X_\infty|^p) &= E_P(\liminf_m |X_r - X_{k_m}|^p) \leq \liminf_m E_P(|X_r - X_{k_m}|^p) \leq 2^{-np} \end{aligned}$$

jossa käytettiin Fatoun lemma. Minkowskin epäyhtälöstä seuraa $X_\infty \in L^p$, ja $X_r \xrightarrow{L^p} X_\infty$ kun $r \rightarrow \infty$ \square

9.1 Projektio $L^2(P)$ avaruudessa

Lause 9.1.1. Olkoon $H \subseteq L^2(\Omega, \mathcal{F}, P)$ aliavaruus joka on **suljettu**, eli jos $\{X_n\} \subseteq H$ ja on olemassa $X \in L^2(P)$ jolla $\|X_n - X\|_{L^2(P)} \rightarrow 0$, siitä seuraa $X \in H$.

Kaikille $X(\omega) \in L^2(\Omega, \mathcal{F}, P)$ on olemassa ortogonaalinen projektio H -aliavaruuteen $Y(\omega) = (\Pi_H X)(\omega) \in H$ jolla

1. $E_P((X - Y)^2) = \Delta^2 := \inf_{W \in H} E_P((X - W)^2)$,
2. $E_P((X - Y)W) = 0, \forall W \in H$.

Projektio Y on P -melkein varmasti yksikäsitteinen.

Huomautus 9.1.1. Muistetaan että Eukliidisessa avaruudessa \mathbb{R}^d on määritelty vektoreiden skalaari tulo

$$\langle X, Y \rangle_{\mathbb{R}^d} = \sum_{\omega=1}^d X(\omega)Y(\omega) = d \cdot \sum_{\omega=1}^d X(\omega)Y(\omega)P(\{\omega\}) = E_P(XY)d$$

jossa $P(\omega) = 1/d$ on tasainen todennäköisyys äärellisessä avaruudessa $\Omega = \{1, \dots, d\}$. Sanomme että vektorit $X, Y \in \mathbb{R}^d$ ovat kohtisuoria (merkintä $X \perp_{\mathbb{R}^d} Y$), kun $\langle X, Y \rangle_{\mathbb{R}^d} = 0$. Tämä geometrinen käsite yleistyy varustamalla $L^2(\Omega, \mathcal{F}, P)$ skalaaritulolla

$$\langle X, Y \rangle_{L^2(P)} = E_P(XY) = \int_{\Omega} X(\omega)Y(\omega)P(d\omega)$$

ja tulkitaan satunnaismuuttuja $(X(\omega) : \omega \in \Omega)$ ääretönulotteisena vektorina. Satunnais-muuttujat $X, Y \in L^2(P)$ ovat kohtisuoria (merkintä $X \perp_P Y$), kun $E_P(XY) = 0$.

Tod. Koska $0 \in H$, $\Delta^2 \leq E_P(X^2) < \infty$,

ja on olemassa jono $(Y_n : n \in \mathbb{N}) \subseteq H$ jolla $\|X - Y_n\|_2 \rightarrow \Delta$. Osoitamme että $(Y_n : n \in \mathbb{N})$ on Cauchy jono. Olkoon $\varepsilon > 0$ ja \bar{n} jolla kun $n \geq \bar{n}$

$$\Delta^2 \leq E_P((X - Y_n)^2) < \Delta^2 + \varepsilon.$$

Kun sovelletaan suunnikkaan identiteetti vektoreille

$(Y_n - Y_m)/2$ ja $(X - (Y_n + Y_m)/2)$, seuraa

$$2 \| (Y_m - Y_n)/2 \|_2^2 = \| X - Y_m \|_2^2 + \| X - Y_n \|_2^2 - 2 \| X - (Y_m + Y_n)/2 \|_2^2.$$

Koska $(Y_n + Y_m)/2 \in H$,

$$\| X - (Y_n + Y_m)/2 \|_2^2 \geq \Delta^2,$$

ja kun $n, m \geq \bar{n}$ seuraa

$$2 \| (Y_m - Y_n)/2 \|_2^2 \leq 2\varepsilon.$$

Siksi $(Y_n) \subseteq H$ on Cauchy jono $L^2(P)$:ssa, ja $L^2(P)$ täydellisyydestä seuraa että on olemassa $Y \in L^2(P)$ jolla $Y_n \xrightarrow{L^2} Y$, ja koska H on suljettu aliavaruus seuraa $Y \in H$. Kun $W \in H \setminus \{0\}$ ja $t \in \mathbb{R}$, $(Y + tW) \in H$, ja $\forall t \in \mathbb{R}$

$$\begin{aligned} \| X - Y \|_2^2 &\leq \| X - Y - tW \|_2^2 = \| X - Y \|_2^2 + t^2 \| W \|_2^2 - 2tE_P((X - Y)W) \\ &\iff t^2 \| W \|_2^2 \geq 2tE_P((X - Y)W) \quad \forall t \in \mathbb{R} \end{aligned}$$

josta seuraa $E_P((X - Y)W) = 0$. Jos $\tilde{Y}(\omega) \in H$ olisi myös projektiio, ottamalla $W = (Y - \tilde{Y}) \in H$,

$$\begin{aligned} 0 &= E_P(XW) - E_P(XW) = E_P(YW) - E_P(\tilde{Y}W) = E_P((Y - \tilde{Y})W) \\ &= E_P((Y - \tilde{Y})^2) \end{aligned}$$

josta seuraa $Y(\omega) = \tilde{Y}(\omega)$ P -m.v. \square

Lemma 9.1.1. L^2 -projektiio on lineaarinen operaattori: kun $X, Z \in L^2(P)$, $a, b \in \mathbb{R}$ ja H on suljettu aliavaruus,

$$\Pi_H(aX + bZ) = a\Pi_H X + b\Pi_H Z,$$

Todistus: harjoitustehtävä.

Esimerkki 9.1.1. (Projektiio satunnaismuuttujan virittämään lineaariseen aliavaruuteen): Olkoon olkoon $Y(\omega) \in L^2(P)$ jolla $E_P(Y^2) > 0$, ja

$$H = \{ aY(\omega) + b : a, b \in \mathbb{R} \} \subseteq L^2(P).$$

Koska

$$H = \{ a(Y(\omega) - E_P(Y)) + b : a, b \in \mathbb{R} \}$$

$Y(\omega)$ ja $(Y(\omega) - E_P(Y))$ virittävät saman lineaarisen aliavaruuden. Siksi voidaan olettaa $E_P(Y) = 0$.

Osoitan että H on suljettu: olkoon $X_n(\omega) = (a_n Y(\omega) + b_n) \in H$ jossa $(a_n), (b_n) \subseteq \mathbb{R}$, jolla

$$E_P((X_n - X)^2) = E_P((a_n Y + b_n - X)^2) \rightarrow 0$$

Silloin (X_n) on Cauchy jono $L^2(P)$:ssa, josta seuraa

$$E_P(Y^2)(a_n - a_m)^2 + (b_n - b_m)^2 \rightarrow 0$$

kun $n, m \rightarrow \infty$, ja koska $E_P(Y^2) > 0$, (a_n) ja (b_n) ovat Cauchy jonoja \mathbb{R} :ssa. Koska \mathbb{R} on täydellinen, on olemassa $a, b \in \mathbb{R}$ jolla $a_n \rightarrow a$ ja $b_n \rightarrow b$. Tästä seuraa $(a_n Y + b_n) \rightarrow (aY + b)$ $L^2(P)$ -normissa, ja $X(\omega) = (aY(\omega) + b)$ P -melkein

varmasti, eli $X \in H$. Esitämme X :n projektio aliavaruuteen H : mimoidaan yli $a, b \in \mathbb{R}$

$$E_P\left(\{aY + b - X\}^2\right) = E(X^2) + a^2E(Y^2) + b^2 + 2abE(Y) - 2aE(XY) - 2bE(X).$$

Koska oletetusti $E(Y) = 0$,

$$\begin{aligned}\frac{\partial}{\partial a}E_P\left(\{aY + b - X\}^2\right) &= 2aE(Y^2) - 2E(XY) \\ \frac{\partial}{\partial b}E_P\left(\{aY + b - X\}^2\right) &= 2b - 2E(X)\end{aligned}$$

josta seuraa $b = E(X)$, $a = E(Y^2)/E(XY)$. Siis kun $E(Y) = 0$, X :n projektio Y :n virittämään aliavaruuteen H :n on

$$\Pi_H(X) = E_P(X) + \frac{E(XY)}{E(Y^2)}Y$$

Yleisemmin

$$\Pi_H(X) = E(X) + \frac{\text{Cov}(XY)}{\text{Var}(Y^2)}(Y - E(Y))$$

Luku 10

Ehdollinen odotusarvo

Olkoon $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ ali- σ -algebra.

Silloin $L^p(\Omega, \mathcal{G}, P) \subseteq L^p(\Omega, \mathcal{F}, P)$, $\forall 0 \leq p \leq \infty$, ja kun $p > 0$, $L^p(\Omega, \mathcal{G}, P)$ on suljettu aliavaruus.

Tod. Olkoon $\{X_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq L^p(\Omega, \mathcal{G}, P)$ ja $X \in L^p(\Omega, \mathcal{F}, P)$ joilla $E_P(|X_n - X|^p) \rightarrow 0$. Seuraa että $X \implies X_n \xrightarrow{P} X$ ja on olemassa alijono jolla $\{n_k\} : X_{n_k}(\omega) \rightarrow X(\omega)$ P m.v. . Olkoon $\tilde{X}(\omega) := \liminf_k X_{n_k}(\omega) \in L^p(\Omega, \mathcal{G}, P)$. Seuraa että $X_n \xrightarrow{L^p} \tilde{X}$ ja siksi $X(\omega) = \tilde{X}(\omega)$ P -m.v.

Kun $X \in L^2(\Omega, \mathcal{F}, P)$ ja $H = L^2(\Omega, \mathcal{G}, P)$ seuraa projektio lauseesta (9.1.1) että on olemassa ortogonaalinen projektio

$$Y(\omega) = E_P(X|\mathcal{G})(\omega) := (\Pi_{L^2(\Omega, \mathcal{G}, P)} X)(\omega)$$

joka kutsutaan *ehdolliseksi odotusarvoksi* jolla

- $Y \in L^2(\Omega, \mathcal{G}, P)$
- $E_P(XW) = E_P(YW) \quad \forall W \in L^2(\Omega, \mathcal{G}, P)$

Lemma 10.0.2. *Ehdollinen odotusarvo on positiivinen operaattori:*

Olkoon $0 \leq X(\omega) \in L^\infty(\Omega, \mathcal{F}, P)$, $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ ali- σ -algebra. Silloin

$$Y(\omega) = E_P(X|\mathcal{G})(\omega) \geq 0 \quad P\text{-m.v.}$$

Tod. Koska $L^\infty(P) \subseteq L^2(P)$ ehdollinen odotusarvo $Y(\omega)$ on olemassa L^2 -projektiona. Olkoon $A = \{\omega : Y(\omega) < 0\} \in \mathcal{G}$. Koska $\mathbf{1}_A(\omega) \in L^\infty(P) \subseteq L^2(P)$,

$$0 \leq E_P(X\mathbf{1}_A) = E_P(Y\mathbf{1}_A) = E_P(Y\mathbf{1}_{(Y < 0)}) = -E_P(Y^-) \leq 0$$

ja väite seuraa.

Ehdollisen odotusarvon määritelmä laajennetaan $L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$ avaruuteen:

Teoreema 10.0.1. (Kolmogorovin määritelmä) Kun $X \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$, ja $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ on ali- σ -algebra, on olemassa ehdollinen odotusarvo $Y(\omega) = E_P(X|\mathcal{G})(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{G}, P)$ jolla $Y \in L^1(\Omega, \mathcal{G}, P)$ ja

$$E_P(X\mathbf{1}_A) = E_P(Y\mathbf{1}_A) \quad \forall A \in \mathcal{G}$$

Ehdollinen odotusarvo on P -m.v. yksikäsitteinen.

Tod. Voidaan olettaa että $X(\omega) \geq 0 \forall \omega$, muuten käytämme ensin hajotelmaa $X(\omega) = X(\omega)^+ - X(\omega)^-$ ja sitten määrittelemme

$$E_P(X^+|\mathcal{G})(\omega) = E_P(X^+|\mathcal{G})(\omega) - E_P(X^-|\mathcal{G})(\omega)$$

Olkoon $0 \leq X_n(\omega) = X(\omega) \wedge n \uparrow X(\omega)$ kun $n \uparrow \infty$. Koska $X_n \in L^\infty$ seuraa että $X_n \in L^2(\Omega, \mathcal{F}, P)$ ja projektio lauseesta seuraa että on olemassa $Y_n \in L^2(\Omega, \mathcal{G}, P)$ jolla

$$E_P(X_n\mathbf{1}_A) = E_P(Y_n\mathbf{1}_A) \quad \forall A \in \mathcal{G}$$

Seuraa lemmasta (10.0.2) että $Y_n(\omega) \geq 0$ P -melkein varmasti.

Kun $n \geq m$ $(X_n(\omega) - X_m(\omega)) \geq 0$ josta seuraa

$$(Y_n(\omega) - Y_m(\omega)) = E_P(X_n|\mathcal{G})(\omega) - E_P(X_m|\mathcal{G})(\omega) = E_P(X_n - X_m|\mathcal{G})(\omega) \geq 0 \quad P\text{-m.v.}$$

Olkoon $Y(\omega) = \limsup_n Y_n(\omega)$. Seuraa että $Y_n(\omega) \uparrow Y(\omega)$ P -m.v. ja monotonisen konvergenssin lauseesta, $\forall A \in \mathcal{G}$

$$E_P(X\mathbf{1}_A) = \lim_{n \uparrow \infty} E_P(X_n\mathbf{1}_A) = \lim_{n \uparrow \infty} E_P(Y_n\mathbf{1}_A) = E_P(Y\mathbf{1}_A)$$

Jos $\tilde{Y}(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{G}, P)$ toteuttaa Kolmogorovin määritelmää, koska $A = \{\omega : Y(\omega) > \tilde{Y}(\omega)\} \in \mathcal{G}$,

$$0 \leq E_P((Y - \tilde{Y})\mathbf{1}_A) = E_P(X\mathbf{1}_A) - E_P(X\mathbf{1}_A) = 0$$

seuraa että $Y(\omega) \leq \tilde{Y}(\omega)$ P -m.v., samoin seuraa että $Y(\omega) \geq \tilde{Y}(\omega)$ ja siksi $Y(\omega) = \tilde{Y}(\omega)$ P -m.v.

Tehtävä 10.0.1. Osoita että (10.0.1) pätee jos ja vain jos

$$E_P(XW) = E_P(YW) \quad \forall W \in L^\infty(\Omega, \mathcal{G}, P)$$

Tehtävä 10.0.2. Olkoon $\mathcal{G} = \sigma(A_1, \dots, A_n) \subseteq \mathcal{F}$ äärellisesti generoitu ali σ -algebra, jossa $\{A_1, \dots, A_n\}$ on Ω :n \mathcal{F} -mitallinen ositus, $A_i \in \mathcal{F}$, $\bigcup_{i=1}^n A_i = \Omega$, $A_i \cap A_j = \emptyset$ kun $i \neq j$.

Olkoon $X(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$. Silloin

$$E_P(X|\mathcal{G})(\omega) = \sum_{i=1}^n \frac{E_P(X\mathbf{1}_{A_i})}{P(A_i)} \mathbf{1}_{A_i}(\omega) := \sum_{i=1}^n E_P(X|A_i) \mathbf{1}_{A_i}(\omega) \quad (10.0.1)$$

jossa $E_P(X|A) = E_P(X\mathbf{1}_A)/P(A)$ on elementaarinen ehdollinen odotusarvo, joka saa mielivaltainen arvo (esimerkiksi 0) silloin kun $P(A) = 0$. Osoita että (10.0.1) toteuttaa Kolmogorovin ehdollisen odotusarvon määritelmän. (10.0.1) yleistyy myös tapaukseen jossa mitallinen ositus $\{A_i : i \in \mathbb{N}\}$ on numeroituva, silloin

$$E_P(X|\mathcal{G})(\omega) = \sum_{i \in \mathbb{N}} \frac{E_P(X\mathbf{1}_{A_i})}{P(A_i)} \mathbf{1}_{A_i}(\omega) := \sum_{i \in \mathbb{N}} E_P(X|A_i) \mathbf{1}_{A_i}(\omega)$$

Huom: Kolmogorovin ehdollinen odotusarvo σ -algebran ehdolla $E_P(X|\mathcal{G})(\omega)$ on satunnaismuuttuja, kun elementaarinen odotusarvo tapahtuman ehdolla $E_P(X|A)$ on vakio joka on hyvin määritelty vain silloin kun $P(A) > 0$.

10.1 Ehdollinen odotusarvo Radon-Nykodim derivaattana

Olkoon $X \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$ Määritellään merkkinen mitta

$$\mu_X(A) = E_P(X\mathbf{1}_A) \quad \forall A \in \mathcal{F}$$

Huomataan että $\mu_X(A) = 0$ silloin kun $A \in \mathcal{F}$ ja $P(A) = 0$, eli $\mu \ll P$ σ -algebrassa \mathcal{F} , ja $X(\omega) = \frac{d\mu_X}{dP}(\omega)$ on vastaava Radon-Nikodymin derivaatta.

Olkoon $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ ali σ -algebra. Erityisesti $\mu \ll P$ σ -algebrassa \mathcal{G} . Radon-Nikodymin lauseesta seuraa että on olemassa R-N derivaatta

$$Y(\omega) := \frac{d\mu_X|_{\mathcal{G}}}{dP|_{\mathcal{G}}}(\omega)$$

jossa $Y(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{G}, P)$ joka toteuttaa mitanvaihtokaavaa

$$E_P(X\mathbf{1}_A) = \mu_X(A) = E_P(Y\mathbf{1}_A) \quad \forall A \in \mathcal{G}$$

Kolmogorovin määritelmästä seuraa että $Y(\omega) = E_P(X|\mathcal{G})(\omega)$.

Siis ehdollisen odotusarvon olemassa olo seuraa R-N lauseesta. Kuitenkin, koska emme ole vielä todistaneet R-N lauseetta käyttimme L^2 -projektiota.

10.2 Mitä voidaan sanoa kun $E_P(|X|) = \infty$?

Olkoon $0 \leq X(\omega) \in L^0(\Omega, \mathcal{F}, P)$ mutta $E_P(X) = \infty$. Myös tässä tapauksessa monotonisen konvergenssilauseen kautta seuraa että on olemassa ehdollinen odotusarvo $Y(\omega) = E_P(X|\mathcal{G})(\omega) \in [0, +\infty]$ joka on \mathcal{G} -mitallinen joka toteuttaa $\forall A \in \mathcal{G}$.

$$E_P(X\mathbf{1}_A) = E_P(Y\mathbf{1}_A) \in [0, +\infty]$$

Toki $Y(\omega)$ voi saada myös arvoa $+\infty$, joka tapauksessa $E_P(Y) = E_P(X) = \infty$.

Yleisemmin olkoon $X(\omega) = (X(\omega)^+ - X(\omega)^-)$, jossa $E_P(|X|) = \infty$. Silloin ehdollinen odotusarvo

$$E_P(X|\mathcal{G})(\omega) := E_P(X^+|\mathcal{G})(\omega) - E_P(X^-|\mathcal{G})(\omega) \in [-\infty, +\infty]$$

on hyvin määritelty vain joukon

$$U := \{ \omega : E_P(X^+|\mathcal{G})(\omega) = E_P(X^-|\mathcal{G})(\omega) = +\infty \}$$

ulkopuolella. Kun käy hyvin joskus $P(U) = 0$.

10.3 Ehdollisen odotusarvon ominaisuudet

1. Monotoninen konvergenssi :

$$0 \leq X_n(\omega) \uparrow X(\omega) \implies 0 \leq E_P(X_n | \mathcal{G})(\omega) \uparrow E_P(X | \mathcal{G})(\omega) \quad P \text{ m.v.}$$

2. $E_P(E_P(X | \mathcal{G})) = E_P(X)$

3. Kun $\mathcal{H} \subseteq \mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$,

$$E_P(X | \mathcal{H})(\omega) = E_P(E_P(X | \mathcal{G}) | \mathcal{H})(\omega) \quad P \text{ m.v.}$$

4. Jos $Y \in L^1(\Omega, \mathcal{G}, P)$, ja $X, (XY) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$, seuraa

$$E_P(YX | \mathcal{G})(\omega) = Y(\omega)E_P(X | \mathcal{G})(\omega)$$

5. jos σ -algebra \mathcal{H} on P -riippumaton σ -algebrasta $\sigma(X) \vee \mathcal{G}$,

$$E_P(X | \mathcal{G} \vee \mathcal{H}) = E_P(X | \mathcal{G})$$

Tod. $\forall G \in \mathcal{G}, H \in \mathcal{H}$, seuraa

$$E_P(X \mathbf{1}_G \mathbf{1}_H) = E_P(X \mathbf{1}_G)P(H) = E_P(E_P(X | \mathcal{G}) \mathbf{1}_G)P(H) = E_P(E_P(X | \mathcal{G}) \mathbf{1}_G \mathbf{1}_H)$$

ja väite seuraa koska $\mathcal{G} \vee \mathcal{H} = \sigma(G \cap H : G \in \mathcal{G}, H \in \mathcal{H})$.

6. (Jensenin epäyhtälö): Kun $E_P(X | \mathcal{G})$ on hyvin määritelty ja $g : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ on konvekksi,

$$E_P(g(X) | \mathcal{G}) \geq g(E_P(X | \mathcal{G}))$$

Tod.

$$g(X(\omega)) \geq g(E_P(X | \mathcal{G})(\omega)) + \delta(\omega) \left(X(\omega) - E_P(X | \mathcal{G})(\omega) \right)$$

jossa $\delta(\omega) = \nabla g_+(E_P(X | \mathcal{G})(\omega))$ on \mathcal{G} -mitallinen. Kun otetaan ehdollista odotusarvoa molemmista puolesta, väite seuraa odotusarvon positiivisuudesta.

10.4 Säännöllinen ehdollinen todennäköisyys ja ytimet

Tapahtuman $A \in \mathcal{F}$ ehdollinen todennäköisyys ehdolla \mathcal{G} σ -algebra on luonnollisesti

$$P(A|\mathcal{G})(\omega) = E_P(\mathbf{1}_A|\mathcal{G})(\omega)$$

joka on yksikäsitteinen modulo P -nolla mittaisia joukkoja. Koska ehdollinen odotusarvo on ei-negatiivinen operaattori, seuraa $P(A|\mathcal{G})(\omega) \in [0, 1]$ P -melkein varmasti.

Voidaanko sanoa että P -melkein varmasti, kuvaus $A \mapsto P(A|\mathcal{G})(\omega) \in [0, 1]$ on todennäköisyysmitta ?

Olkoon $\{A_n\} \subseteq \mathcal{F}$ tapatuhmien jono jolla $A_n \downarrow \emptyset$. Seuraa ehdollisen odotusarvon monotonisen konvergenssin lauseesta että on olemassa joukko N jolla $P(N) = 0$

$$P(A_n|\mathcal{G})(\omega) \downarrow 0 \quad \forall \omega \in N^c \quad (10.4.1)$$

Tämä joukko voi toki riippua $\{A_n\} \subseteq \mathcal{F}$ jonosta, ja kun yleisesti jonojen määrä on ylinumeroituva, ei mikään takaa että löytyy sellainen P -nolla mittainen joukko N jossa (10.4.1) pätee samaan aikaan kaikille tapahtumien jonoille joilla $A_n \downarrow \emptyset$. Siis ehdollinen todennäköisyys ei ole automaattisesti P -melkein varmasti σ -additiivinen.

Määritelmä 10.4.1. Olkoon (Ω, \mathcal{F}) ja $(\tilde{\Omega}, \tilde{\mathcal{F}})$ todennäköisyysavaruuudet.

Kuvaus $K : \Omega \times \tilde{\mathcal{F}} \rightarrow [0, 1]$ on $(\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\tilde{\Omega}, \tilde{\mathcal{F}})$ todennäköisyys ydin kun

- kaikille kiinnitetyille $\omega \in \Omega$ kuvaus $K(\omega, \cdot) : \tilde{\mathcal{F}} \rightarrow [0, 1]$ jossa $\tilde{A} \mapsto K(\omega, \tilde{A})$ on todennäköisyysmitta.
- kaikille kiinnitetyille tapahtumille $\tilde{A} \in \tilde{\mathcal{F}}$ kuvaus $K(\cdot, \tilde{A}) : \Omega \rightarrow [0, 1]$ jossa $\omega \mapsto K(\omega, \tilde{A})$ on \mathcal{F} -mitallinen.

Määritelmä 10.4.2. Olkoon $\tilde{\Omega} = \Omega$ ja $\tilde{\mathcal{F}} \subseteq \mathcal{F}$, $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$.

10.4. SÄÄNNÖLLINEN EHDOLLINEN TODENNÄKÖISYYS JA YTIMET 139

Ehdollisella todennäköisyydellä $(\tilde{A}, \omega) \mapsto P(\tilde{A}|\mathcal{G})(\omega)$ jossa $\tilde{A} \in \tilde{\mathcal{F}}$ on säännöllinen versio jos on olemassa $(\Omega, \mathcal{G}) \rightarrow (\tilde{\Omega}, \tilde{\mathcal{F}})$ todennäköisyys-ydin $K(\omega, \tilde{A})$, joka on \mathcal{G} -mitallinen ω :n suhteen, ja

$$E_P(X|\mathcal{G})(\omega) = \int_{\tilde{\Omega}} X(\tilde{\omega})K(\omega, d\tilde{\omega})$$

kaikille $X \in L^1(\Omega, \tilde{\mathcal{F}}, P)$

Huomautus 10.4.1. määritelmässä esiintyy ali- σ algebra $\tilde{\mathcal{F}} \subseteq \mathcal{F}$ koska joskus ehdollisen todennäköisyyden säännöllinen versio on olemassa vain jollekin pienelle σ -algebralle eikä alkuperäiselle σ -algebralle \mathcal{F} . Esimerkki: $\tilde{\mathcal{F}} = \sigma(X)$ jossa X on (\mathcal{F} -mitallinen) reaal-arvoinen satunnaismuuttuja.

Määritelmä 10.4.3. Todennäköisyysavaruus (Ω, \mathcal{F}) on Borel jos on olemassa mitallinen injektio

$$\Psi : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow ([0, 1], \mathcal{B}([0, 1]))$$

jonka käänteiskuvaus $\Psi^{-1} : \Psi(\Omega) \rightarrow \Omega$ on myös mitallinen.

Teoreema 10.4.1. Olkoon (Ω, \mathcal{F}, P) todennäköisyyskolmikko, ja $X : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\tilde{\Omega}, \tilde{\mathcal{F}})$ mitallinen kuvaus, jossa $(\tilde{\Omega}, \tilde{\mathcal{F}})$ on Borelin avaruus, ja $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ ali σ -algebra. On olemassa $(\Omega, \mathcal{G}) \rightarrow (\tilde{\Omega}, \tilde{\mathcal{F}})$ todennäköisyys ydin $K(\cdot, \cdot)$ joka on ehdollisen todennäköisyyden säännöllinen versio: P melkein varmasti,

$$P(X \in D|\mathcal{G})(\omega) := E_P(\mathbf{1}(X \in D)|\mathcal{G})(\omega) = K(\omega, D) \quad \text{kaikille } D \in \tilde{\mathcal{F}}$$

Todistus (Katso myös Kallenbergin kirjasta Foundations of Modern Probability, Thm 6.3, 6.4.). Oletan ensin että $\tilde{\Omega} = \mathbb{R}$ ja $\tilde{\mathcal{F}} = \mathcal{B}(\mathbb{R})$. Silloin $\forall q < r \in \mathbb{Q}$, ehdollisen odotusarvon positiivisuudesta seuraa

$$P(X \leq q | \mathcal{G})(\omega) \leq P(X \leq r | \mathcal{G})(\omega) \quad P\text{-melkein varmasti,} \quad (10.4.2)$$

ja koska $\mathbb{Q} \times \mathbb{Q}$ on numeroituva on olemassa $N \subset \Omega$ jolla $P(N) = 0$ ja 10.4.2 pätee samaan aikaan $\forall q \leq r \in \mathbb{Q}, \omega \in N^c$. Määritellän ensin $\forall q \in \mathbb{Q}, \omega \in \Omega$

$$K((-\infty, q], \omega) := P(X \leq q | \mathcal{G}) .$$

Koska $\forall \omega \in N^c$ jolla $P(N^c)$ kuvaus $\mathbb{Q} \ni q \mapsto P(X \leq q | \mathcal{G})(\omega)$ on ei-vähevä, seuraa että

$$K((-\infty, t], \omega) = \begin{cases} \lim_{q \downarrow t, q \in \mathbb{Q}} K((-\infty, q], \omega) & \text{kun } \omega \in \tilde{N}^c \\ Q((-\infty, t]) & \text{kun } \omega \in \tilde{N} \end{cases}$$

on hyvin määritelty kaikille $t \in \mathbb{R}$ ja $\omega \in \Omega$, monotonisen jonon raja-arvona silloin kun $\omega \in N^c$, ja asetetaan mielivaltaisesti $K(dx, \omega) = Q(dx)$ silloin kun $\omega \in N$.

Kuvaus $\omega \mapsto K((-\infty, t], \omega)$ on \mathcal{G} -mitallinen $\forall t \in \mathbb{R}$, ja $\forall \omega \in \Omega$ kuvaus $t \mapsto K((-\infty, t], \omega)$ on todennäköisyysjakauman kertymäfunktio, koska se on ei-vähenevä, oikealta jatkuva, ja toteuttaa

$$\lim_{q \downarrow -\infty, q \in \mathbb{Q}} K((-\infty, q], \omega) = K(\emptyset, \omega) = 0, \quad \lim_{q \uparrow \infty, q \in \mathbb{Q}} K((-\infty, q], \omega) = K(\mathbb{R}, \omega) = 1, \quad \forall \omega \in \Omega.$$

Charatheodoryn laajennuslauseesta seuraa että $\forall \omega \in \Omega$ on olemassa yksikäsitteinen σ -additiivinen laajennus $K(B, \omega)$, joka on todennäköisyysmitta $\mathcal{B}(\mathbb{R})$ σ -algebralla. Seuraavaksi osoitamme että kaikille Borel-mitallisille testi-funktioille $f(x) \geq 0$

$$\int_{\mathbb{R}} f(x) K(dx, \omega) = E_P(f(X) | \mathcal{G})(\omega) \quad (10.4.3)$$

joka tarkoittaa että todennäköisyys ydin $K(B, \omega)$ on säännöllinen versio ehdollisesta todennäköisyydestä $P(X \in B | \mathcal{G})(\omega)$.

Olkoon \mathcal{C} kokoelma kaikista rajoitetuista Borel mitallisista funktioista $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ jotka toteuttavat:

1. kuvaus $\omega \mapsto \int_{\mathbb{R}} f(x) K(dx, \omega)$ on \mathcal{G} -mitallinen
2. 10.4.3 pätee, eli $\forall G \in \mathcal{G}$

$$E_P\left(f(X) \mathbf{1}_G\right) = \int_{\Omega} \left(\int_{\mathbb{R}} f(x) K(dx, \omega)\right) \mathbf{1}_G(\omega) P(d\omega)$$

\mathcal{C} on vektori avaruus joka sisältää vakiot: kun $f, g \in \mathcal{C}$ ja $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$, koska $\forall \omega \in \Omega$ odotusarvo on lineaarinen, integraali

$$\int_{\mathbb{R}} (\alpha f(x) + \beta g(x)) K(dx, \omega) = \alpha \int_{\mathbb{R}} f(x) K(dx, \omega) + \beta \int_{\mathbb{R}} g(x) K(dx, \omega)$$

on \mathcal{G} -mitallinen ω :n suhteen, ja $\forall G \in \mathcal{G}$

$$\begin{aligned} E_P\left((\alpha f(X) + \beta g(X))\mathbf{1}_G\right) &= \alpha E_P(f(X)\mathbf{1}_G) + \beta E_P(g(X)\mathbf{1}_G) = \\ &= \alpha \int_{\Omega} \left(\int_{\mathbb{R}} f(x)K(dx, \omega)\right) \mathbf{1}_G(\omega)P(d\omega) + \beta \int_{\Omega} \left(\int_{\mathbb{R}} g(x)K(dx, \omega)\right) \mathbf{1}_G(\omega)P(d\omega) \\ &= \int_{\Omega} \int_{\mathbb{R}} (\alpha f(x) + \beta g(x))\mathbf{1}_G(\omega)P(d\omega) \end{aligned}$$

\mathcal{C} on suljettu monotonisen rajankäynnin suhteen: Kun $0 \leq f_n(x) \uparrow f(x)$ jossa $\{f_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathcal{C}$, ja $f(x)$ on rajoitettu, seuraa monotonisen konvergenssin lauseesta $\forall \omega \in \Omega$

$$0 \leq \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\mathbb{R}} f_n(x)K(dx, \omega) = \int_{\mathbb{R}} f(x)K(dx, \omega)$$

joka on myös \mathcal{G} -mitallinen, ja $\forall G \in \mathcal{G}$ monotonisen konvergenssin lauseesta seuraa

$$\begin{aligned} E_P(f(X)\mathbf{1}_G) &= \lim_{n \rightarrow \infty} E_P(f_n(X)\mathbf{1}_G) = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\Omega} \left(\int_{\mathbb{R}} f_n(x)K(dx, \omega)\right) \mathbf{1}_G(\omega)P(d\omega) \\ &= \int_{\Omega} \lim_{n \rightarrow \infty} \left(\int_{\mathbb{R}} f_n(x)K(dx, \omega)\right) \mathbf{1}_G(\omega)P(d\omega) = \int_{\Omega} \left(\int_{\mathbb{R}} f(x)K(dx, \omega)\right) \mathbf{1}_G(\omega)P(d\omega) \end{aligned}$$

Koska $\mathbf{1}_{(-\infty, q]}(\cdot) \in \mathcal{C}$ ja $\mathcal{B}(\mathbb{R}) = \sigma((-\infty, q], q \in \mathbb{Q})$, monotonisen luokan lauseesta 3.0.2 seuraa että \mathcal{C} sisältää kaikki rajoitettuja Borel-mitallisia funktioita. Monotonisen konvergenssin lauseesta seuraa että (10.4.3) pätee myös kaikille ei-negatiivisille Borel-mitallisille funktioille. Yleisemmin, kun $(\tilde{\Omega}, \tilde{\mathcal{F}})$ on Borelin avaruus ja

$$\Psi : (\tilde{\Omega}, \tilde{\mathcal{F}}) \longrightarrow ([0, 1], \mathcal{B}([0, 1]))$$

on mitallinen injektio jolla on mitallinen käänteiskuvaus Ψ^{-1} , kun $A \in \tilde{\mathcal{F}}$

$$P(X \in A | \mathcal{G})(\omega) = P(\Psi(X) \in \Psi(A) | \mathcal{G})(\omega) = K(\Psi(A), \omega)$$

jossa $\Psi(A)$ on Borelin joukko, koska Ψ^{-1} on mitallinen, ja todennäköisyys ydin

$$K(B, \omega) = P(\Psi(X) \in B | \mathcal{G})(\omega) \quad P\text{-melkein varmasti } \forall B \in \mathcal{B}(0, 1)$$

on ehdollisen todennäköisyyden säännöllinen versio, joka on olemassa koska $\Psi(X(\omega))$ saa arvoja välissä $[0, 1] \in \mathbb{R}$ \square

Huomautus 10.4.2. Meidän onneksi $(\mathbb{R}^d, \mathcal{B}(\mathbb{R}^d))$ ja yleisemmin kaikki separoituvat metriset avaruudet varustettuina Borelin σ -algebroilla ovat Borelin avaruuksia. \mathbb{R}^d -arvoisen satunnaisvektorin ehdolliset todennäköisyydet ovat aina säännöllisiä. Separoituvassa metrisessä avaruudessa (S, d) on olemassa tiheä numeroituva joukko $(x_n : n \in \mathbb{N}) \subseteq S$ eli $\forall x \in S$ on olemassa indeksien jono $(m_n : n \in \mathbb{N})$ jolla $d(x_{m_n}, x) \downarrow 0$ kun $m \uparrow \infty$. Silloin on myös olemassa mitallinen injektio

$$\Psi : (S, \mathcal{B}(S)) \longrightarrow ([0, 1], \mathcal{B}([0, 1]))$$

jolla on mitallinen käänteiskuvaus seuraavasti: $\forall n \in \mathbb{N}$, olkoon

$$m_n := \arg \min \{d(x, x_k) : k = 1, \dots, 2^n\}$$

jossa silloin kun minimi ei ole yksikäsitteinen valitaan pienin indeksi $1 \leq m_n \leq 2^n$ jolla

$$d(x, x_{m_n}) = \min \{d(x, x_k) : k = 1, \dots, 2^n\}$$

Indeksilla on dyadinen esitys

$$m_n = \sum_{\ell=0}^{n-1} y_\ell^{(n)} 2^\ell$$

jossa $y^{(n)} = (y_0^{(n)}, \dots, y_{n-1}^{(n)}) \in \{0, 1\}^n$. Jokainen piste $x \in S$ kuvautuu binaarijonoon

$$\eta = (y_0^{(1)}, y_0^{(2)}, y_1^{(2)}, y_0^{(3)}, y_1^{(3)}, y_2^{(3)}, \dots)$$

joka vastaa lukua $\Psi(x) \in [0, 1]$. Binaarijonon η informaation perusteella saadaan takaisin indeksijono $\{m_n\}$ ja piste $x = \lim_{n \rightarrow \infty} x_{m_n}$. Jää osoitettavaksi (harjoitustehtävää) että sekä Ψ että sen käänteiskuvaus ovat mitallisia.

10.5 Ehdollisen odotusarvon laskenta riippumattomuuden nojalla

Lause 10.5.1. Todennäköisyysavaruudella (Ω, \mathcal{F}) , olkoon $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ ali σ -algebra, $Y(\omega)$ \mathcal{G} -mitallinen satunnaisuuttuja, joka saa arvot mitallisessa avaruudessa (S, \mathcal{S}) , ja olkoon $X(\omega) \in (\tilde{S}, \tilde{\mathcal{S}})$ riippumaton \mathcal{G} σ -algebrasta.

Olkoon $f : (\tilde{S} \times S) \rightarrow \mathbb{R}$ rajoitettu ja Borel-mitallinen kuvaus.

Silloin ehdollisella odotusarvolla on integraali-esitys

$$E_P(f(X, Y) | \mathcal{G})(\omega) = E_P(f(X, y)) \Big|_{y=Y(\omega)} = \int_{\tilde{S}} f(x, Y(\omega)) P_X(dx) \quad (10.5.1)$$

jossa $P_X(B) = P(\{\omega : X(\omega) \in B\})$.

Tod. Olkoon

$V := \{f : (\tilde{S} \times S) \rightarrow \mathbb{R} \text{ Borel mitalliset ja rajoitetut funktiot joille pätee 10.5.1}\}$

Osoitamme ensi että V on monotoninen luokka. Ehdollisen odotusarvon määritelmästä seuraa 10.5.1 on voimassa funktiolle $f(x, y)$ jos ja vain jos $\forall G \in \mathcal{G}$

$$E_P(f(X, Y) \mathbf{1}_G) = \int_{\Omega} \left\{ \int_{\tilde{S}} f(x, Y(\omega)) P_X(dx) \right\} \mathbf{1}_G(\omega) P(d\omega)$$

Selvästi V on vektori avaruus koska odotusarvo on lineaarinen. Jos $\{f_n(x, y) : n \in \mathbb{N}\} \subseteq V$ ja $0 \leq f_n(x, y) \uparrow f(x, y)$ jossa $f(x, y)$ on rajoitettu, seuraa monotonisen konvergenssin lauseesta että $f(x, y) \in V$.

Monotonisen luokan lauseesta seuraa että jos $\mathcal{I} \subseteq V$ on π -luokka, V sisältää kaikki rajoitettu $\sigma(\mathcal{I})$ mitalliset funktiot. Väite on osoitettu kun näytämme että 10.5.1 pätee funktiolle $f(x, y) = \mathbf{1}_B(x) \mathbf{1}_D(y) : \forall G \in \mathcal{G}$ riippumattomuudesta seuraa

$$\begin{aligned} E_P(\mathbf{1}_B(X) \mathbf{1}_D(Y) \mathbf{1}_G) &= P_X(B) P(\{Y \in D\} \cap G) \\ &= \int_{\Omega} \left\{ \int_{\Omega} \mathbf{1}_B(X(\tilde{\omega})) P(d\tilde{\omega}) \right\} \mathbf{1}_D(Y(\omega)) \mathbf{1}_G(\omega) P(d\omega) = \\ &= \int_{\Omega} \left\{ \int_{\Omega} \mathbf{1}_B(X(\tilde{\omega})) \mathbf{1}_D(Y(\omega)) P(d\tilde{\omega}) \right\} \mathbf{1}_G(\omega) P(d\omega) = \\ &= \int_{\Omega} \left\{ \int_{\Omega} f(X(\tilde{\omega}), Y(\omega)) P(d\tilde{\omega}) \right\} \mathbf{1}_G(\omega) P(d\omega) \end{aligned}$$

joka tarkoittaa $\mathbf{1}_B(x) \mathbf{1}_D(y) \in V \quad \square$

10.6 Ehdollisen odotusarvon laskenta mitan-vaihdon avulla: Bayesin kaava

Lemma 10.6.1. *Ehdollinen odotusarvon on itse-adjungoitu operaattori, eli kun $X \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$, $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ on ali σ -algebra, $\forall A \in \mathcal{F}$*

$$E_P(X E_P(\mathbf{1}_A|\mathcal{G})) = E_P(E_P(X|\mathcal{G}) E_P(\mathbf{1}_A|\mathcal{G})) = E_P(E_P(X|\mathcal{G}) \mathbf{1}_A)$$

Tod. Suoraan ehdollisen odotusarvon ominaisuuksista.

Olemme esittäneet kaksi tapausta jossa osaamme laskea ehdollisia odotusarvoja: silloin kun σ -algebralla \mathcal{G} on numeroituva määrä atomeja, ja riippumattomuuden nojalla lauseessa 10.5.1.

Yleisemmin voidaan joskus paluuttaa ehdollisen odotusarvon laskeminen lauseen 10.5.1 tilanteeseen mitan-vaihdon avulla. Ensin esitämme mitanvaihtokaavan ehdolliselle odotusarvolle:

Teoreema 10.6.1. *(Abstrakti Bayesin kaava). Todennäköisyysavaruudella (Ω, \mathcal{F}) , olkoon $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ ja $P \stackrel{\mathcal{F}}{\ll} Q$ todennäköisyysmitat joilla $Q(A) = 0 \implies P(A) = 0$ kun $A \in \mathcal{F}$.*

Radon-Nikodym lauseesta seuraa että on olemassa Radon-Nikodym derivaatta eli satunnaismuuttuja

$$0 \leq Z(\omega) := \frac{dP}{dQ}(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, Q)$$

jolle odotusarvon mitanvaihtokaava on voimassa:

$$E_P(X) = E_Q(XZ) \quad \forall X \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$$

Silloin ehdolliselle odotusarvolle pätee Bayesin kaava:

$$E_P(X|\mathcal{G})(\omega) = \frac{E_Q(XZ|\mathcal{G})(\omega)}{E_Q(Z|\mathcal{G})(\omega)} \in L^1(\Omega, \mathcal{G}, P) \quad (10.6.1)$$

Huomautus 10.6.1. *Olkoon*

$$N = \{ \omega : E_Q(Z|\mathcal{G})(\omega) = 0 \}$$

10.6. EHDOLLISEN ODOTUSARVON LASKENTA MITAN-VAIHDON AVULLA: BAYESIN KAAVA

$N \in \mathcal{G}$ koska $E_Q(Z|\mathcal{G})$ on \mathcal{G} -mitallinen, mitan vaihto kaavasta ja ehdollisen odotusarvon määritelmästä

$$P(N) = E_Q(Z\mathbf{1}_N) = E_Q\left(E_Q(Z|\mathcal{G})\mathbf{1}_N\right) = E_Q\left(E_Q(Z|\mathcal{G})\mathbf{1}_{\{E_Q(Z|\mathcal{G})=0\}}\right) = 0$$

Seuraa että P -melkein varmasti (mutta ei välttämättä Q -melkein varmasti) $E_P(Z|\mathcal{G})(\omega) > 0$, ja yhtälön (10.6.1) vasen puoli on hyvin määritelty.

Tod. Olkoon $G \in \mathcal{G}$. Mitanvaihto kaavasta odotusarvolle ja ehdollisen odotusarvon määritelmästä seuraa

$$\begin{aligned} E_P(X\mathbf{1}_G) &= E_Q(ZX\mathbf{1}_G) = E_Q(E_Q(ZX\mathbf{1}_G|\mathcal{G})) = E_Q(E_Q(ZX|\mathcal{G})\mathbf{1}_G) \\ &= E_Q\left(\frac{E_Q(Z|\mathcal{G})}{E_Q(Z|\mathcal{G})}E_Q(ZX|\mathcal{G})\mathbf{1}_G\right) = E_Q\left(Z\frac{E_Q(ZX|\mathcal{G})}{E_Q(Z|\mathcal{G})}\mathbf{1}_G\right) = E_P\left(\frac{E_Q(ZX|\mathcal{G})}{E_Q(Z|\mathcal{G})}\mathbf{1}_G\right) \quad \square \end{aligned}$$

Esimerkki 10.6.1. (Perinteinen Bayesin kaava) Todennäköisyysavaruudella (Ω, \mathcal{F}) , olkoon $X(\omega) \in \mathbb{R}^d, Y(\omega) \in \mathbb{R}^m$ satunnaismuuttujia joilla $\mathcal{F} = \sigma(X, Y)$, $\mathcal{G} = \sigma(Y)$.

Olkoon $P \stackrel{\mathcal{F}}{\ll} Q$ todennäköisyysmitat joilla $X \perp\!\!\!\perp Y$ ja olkoon

$$0 \leq Z(\omega) := z(X(\omega), Y(\omega)) = \frac{dP}{dQ}(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, Q)$$

jollakin Borel-mitallisilla funktiolla $z(x, y) \geq 0$. Olkoon $f(x, y)$ rajoitettu Borel-mitallinen kuvaus. Bayesin kaavasta

$$\begin{aligned} E_P(f(X, Y)|\mathcal{G})(\omega) &= \frac{E_Q(f(X, Y)Z|\mathcal{G})(\omega)}{E_Q(Z|\mathcal{G})(\omega)} \\ &= \frac{\int_{\Omega} f(X(\tilde{\omega}), Y(\omega)) z(X(\tilde{\omega}), Y(\omega))Q(d\tilde{\omega})}{\int_{\Omega} z(X(\tilde{\omega}), Y(\omega))Q(d\tilde{\omega})} \\ &= \int_{\Omega} f(X(\tilde{\omega}), Y(\omega))K(\omega, d\tilde{\omega}) \quad \text{jossa} \\ K(\omega, d\tilde{\omega}) &= \frac{z(X(\tilde{\omega}), Y(\omega))}{\int_{\Omega} z(X(\omega'), Y(\omega))Q(d\omega')}Q(d\tilde{\omega}) \end{aligned}$$

on ehdollisen todennäköisyyden ydin. Voidaan myös integroida suoraan \mathbb{R}^d avaruudessa jossa $X(\omega)$ saa arvoja:

$$E_P(f(X, Y)|\mathcal{G})(\omega) = \frac{\int_{\mathbb{R}^d} f(x, Y(\omega))z(x, Y(\omega))Q_X(dx)}{\int_{\mathbb{R}^d} z(x, Y(\omega))Q_X(dx)} = \int_{\mathbb{R}^d} f(x, Y(\omega))k(Y(\omega), dx)$$

jossa

$$k(y, dx) = \frac{z(x, y)}{\int_{\mathbb{R}^d} z(x', y) Q_X(dx')} Q_X(dx)$$

Kun satunnaisvektorin (X, Y) jakaumalla on tiheysfunktio $(d + m)$ -ulotteisen Lebesgue mitan suhteen, siis $P(X \in dx, Y \in dy) = p_{X,Y}(x, y) dx dy$, Fubini lauseesta seuraa että silloin myös marginaalijakaumilla P_X ja P_Y ovat tiheydet,

$$P(X \in dx) = p_X(x) dx = \int_{\mathbb{R}^m} p_{X,Y}(x, y) dy$$

$$P(Y \in dy) = p_Y(y) dy = \int_{\mathbb{R}^d} p_{X,Y}(x, y) dx$$

ja voidaan valita todennäköisyysavaruudeksi $\Omega = \mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^m$ todennäköisyysmitoilla

$$Q_{X,Y}(dx, dy) := (P_X \otimes P_Y)(dx, dy) = p_X(x) p_Y(y) dx dy, \quad P_{X,Y}(dx, dy) = p_{X,Y}(x, y) dx dy$$

Oletuksesta $P_{X,Y} \ll (P_X \otimes P_Y)$, seuraa että Radon Nykodim derivaatta on

$$\frac{dP_{X,Y}}{dQ_{X,Y}}(x, y) = \frac{dP_{X,Y}}{d(P_X \otimes P_Y)}(x, y) = z(x, y) = \frac{p_{X,Y}(x, y)}{p_X(x) p_Y(y)}$$

Voidaan silloin kirjoittaa ehdollisen todennäköisyyden ytimen tiheysfunktioiden avulla

$$k(y, dx) = \frac{z(x, y)}{\int_{\mathbb{R}^d} z(x', y) P_X(dx')} P_X(dx) = \frac{p_{X,Y}(x, y)}{p_Y(y)} dx = p_{X|Y}(x|y) dx$$

jossa viimeinen yhtälö on ehdollisen tiheysfunktion määritelmä. Perinteinen Bayesin kaava on

$$p_{X|Y}(x|y) = \frac{p_{X,Y}(x, y)}{p_Y(y)} = \frac{p_X(x) p_{Y|X}(y|x)}{p_Y(y)}.$$

10.6.1 Ehdollisen odotusarvon laskenta tuloavaruudessa

Olkoon (Ω, \mathcal{F}, P) todennäköisyyskolmikko ja $\mathcal{H} \subseteq \mathcal{F}, \mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$.

Tuloavaruudessa $(\Omega \times \Omega)$ varustettuna tulo σ -algebralla $\mathcal{H} \otimes \mathcal{G}$ määritellään Dynkinin laajennuslauseen kautta todennäköisyysmitta \mathbb{P} jolla

$$\mathbb{P}(H \times G) = P(H \cap G) \quad \forall H \in \mathcal{H}, G \in \mathcal{G}$$

Lause 10.6.1. Olkoon $X(\omega, \omega') \in L^1(\Omega \times \Omega, \mathcal{H} \otimes \mathcal{G}, \mathbb{P})$.

Silloin

$$\iint_{\Omega \times \Omega} X(\omega, \omega') \mathbb{P}(d\omega \times d\omega') = \int_{\Omega} X(\omega, \omega) P(d\omega) \quad (10.6.2)$$

Tod. Kun $X(\omega, \omega') = \mathbf{1}_H(\omega) \mathbf{1}_G(\omega')$ jossa $H \in \mathcal{H}$ ja $G \in \mathcal{G}$, väite seuraa suoraan \mathbb{P} :n määritelmästä. Olkoon

$V := \{X(\omega, \omega') : \text{rajoitetut ja } \mathcal{H} \otimes \mathcal{G}\text{-mitalliset s.m. joilla (10.6.2) on voimassa} \}$

Selvästi V on vektori avaruus, ja monotonisen konvergenssin lauseesta seuraa että V on monotoninen luokka. Koska V sisältää satunnaismuuttujat $\mathbf{1}_H(\omega) \mathbf{1}_G(\omega')$ jossa $H \in \mathcal{H}$ ja $G \in \mathcal{G}$, monotonisen luokan lauseesta seuraa sisältää myös kaikki rajoitetut $\mathcal{H} \otimes \mathcal{G}$ -mitalliset satunnaismuuttujat.

Yleisemmin kun X on ei-rajoitettu ja $\mathcal{H} \otimes \mathcal{G}$ -mitallinen voidaan ensin hajottaa $X = (X^+ - X^-) \in L^1(\Omega \times \Omega, \mathcal{H} \otimes \mathcal{G}, P^{\otimes 2})$ satunnais-muuttujien jonolla $X_n = (X^+ \wedge n) - (X^- \wedge n)$, ja käyttää monotonisen konvergenssin lausetta erikseen positiivisille ja negatiivisille puolille \square

Esimerkki 10.6.2. Olkoon $\xi(\omega), \eta(\omega) \in \mathbb{R}$ satunnaismuuttujat $\mathcal{H} = \sigma(\xi)$, $\mathcal{G} = \sigma(\eta)$. Jos $X(\omega, \omega') \geq 0$ on $\sigma(\xi) \otimes \sigma(\eta)$ -mitallinen, on olemassa Borel-mitallinen kuvaus $f : (\mathbb{R} \times \mathbb{R}) \rightarrow \mathbb{R}^+$ jolla $X(\omega, \omega') = f(\xi(\omega), \eta(\omega'))$. Silloin

$$\int_{\Omega} f(\xi(\omega), \eta(\omega)) P(d\omega) = \iint_{\Omega \times \Omega} f(\xi(\omega), \eta(\omega')) \mathbb{P}(d\omega, d\omega')$$

Oletamme nyt että σ -algebrat \mathcal{H} ja \mathcal{G} ovat P -riippumattomia eli

$$P(H \cap G) = P(H)P(G) \text{ kun } H \in \mathcal{H} \text{ ja } G \in \mathcal{G}$$

Silloin $\mathbb{P} = P \otimes P = P^{\otimes 2}$ eli

$$\mathbb{P}(H \times G) = P(H \cap G) = P(H)P(G) \quad \forall H \in \mathcal{H}, G \in \mathcal{G}$$

Tästä esityksestä seuraa suoraan että kun $G \in \mathcal{G}$, $X(\omega, \omega) = f(\xi(\omega), \eta(\omega))$,

$$\begin{aligned} E_P(X \mathbf{1}_G) &= \int_{\Omega} X(\omega, \omega) \mathbf{1}_G(\omega) P(d\omega) = \iint_{\Omega \times \Omega} X(\omega, \omega') \mathbf{1}_G(\omega') P^{\otimes 2}(d\omega, d\omega') \\ &= \int_{\Omega} \left\{ \int_{\Omega} X(\omega, \omega') P(d\omega) \right\} \mathbf{1}_G(\omega') P(d\omega') \end{aligned}$$

ehdollisen odotusarvon määritelmästä seuraa

$$E_P(X|\mathcal{G})(\omega') = \int_{\Omega} X(\omega, \omega')P(d\omega)$$

joka vastaa kaavan (10.5.1)

Yleisemmin, kun σ -algebrat \mathcal{H} ja \mathcal{G} eivät ole riippumattomia P -mitan suhteen, oletamme että $\mathbb{P} \ll P^{\otimes 2}$ tulo σ -algebrassa $(\mathcal{H} \otimes \mathcal{G})$, eli $\mathbb{P}(C) = 0$ kun $C \in (\mathcal{H} \otimes \mathcal{G})$ ja $P^{\otimes 2}(C) = 0$.

Seuraa Radon-Nikodymin lauseesta että on olemassa $(\mathcal{H} \otimes \mathcal{G})$ -mitallinen Radon-Nikodymin derivaatta

$$0 \leq Z(\omega, \omega') := \frac{d\mathbb{P}}{dP^{\otimes 2}}(\omega, \omega') \in L^1(\Omega \times \Omega, \mathcal{H} \otimes \mathcal{G}, P^{\otimes 2})$$

jolla mitan vaihdon kaava on voimassa kaikille $X \in L^1(\Omega \times \Omega, \mathcal{H} \otimes \mathcal{G}, \mathbb{P})$

$$\begin{aligned} \int_{\Omega} X(\omega, \omega)P(d\omega) &= \iint_{\Omega \times \Omega} X(\omega, \omega')\mathbb{P}(d\omega, d\omega') = \iint_{\Omega \times \Omega} X(\omega, \omega')Z(\omega, \omega')P^{\otimes 2}(d\omega, d\omega') = \\ &= \int_{\Omega} \left(\int_{\Omega} X(\omega, \omega')Z(\omega, \omega')P(d\omega) \right) P(d\omega') \end{aligned}$$

Kun $G \in \mathcal{G}$ saadaan

$$\begin{aligned} \int_{\Omega} X(\omega, \omega)\mathbf{1}_G(\omega)P(d\omega) &= \\ \iint_{\Omega \times \Omega} X(\omega, \omega')\mathbf{1}_G(\omega')\mathbb{P}(d\omega, d\omega') &= \int_{\Omega} \left(\int_{\Omega} X(\omega, \omega')Z(\omega, \omega')P(d\omega) \right) \mathbf{1}_G(\omega')P(d\omega') = \\ \int_{\Omega} Y(\omega')\mathbf{1}_G(\omega')P(d\omega'), \end{aligned}$$

jossa

$$Y(\omega') = \int_{\Omega} X(\omega, \omega')Z(\omega, \omega')P(d\omega)$$

on \mathcal{G} -mitallinen,

$$\begin{aligned} &= \iint_{\Omega \times \Omega} Z(\omega, \omega')Y(\omega')\mathbf{1}_G(\omega')P^{\otimes 2}(d\omega \times d\omega') = \iint_{\Omega \times \Omega} Y(\omega')\mathbf{1}_G(\omega')\mathbb{P}(d\omega, d\omega') \\ &= \int_{\Omega} Y(\omega')\mathbf{1}_G(\omega')P(d\omega') \end{aligned}$$

Kolmogorovin ehdollisen odotusarvon määritelmästä seuraa $Y(\omega') = E_P(X|\mathcal{G})(\omega')$.

Huomataan myös että

$$K(\omega, d\omega') := Z(\omega, \omega')P(d\omega')$$

on ehdollisen todennäköisyyden ydin: $\forall A \in \mathcal{H}$, kuvaus

$$\omega \mapsto K(\omega, A) := \int_A Z(\omega, \omega')P(d\omega')$$

on \mathcal{G} -mitallinen, ja $\int_{\Omega} Z(\omega, \omega')P(d\omega) \equiv 1$ koska

$$\begin{aligned} \mathbb{P}(\Omega \times G) &= P(\Omega \cap G) = P(G) = P(\Omega)P(G) = P^{\otimes 2}(\Omega \times G) \quad \forall G \in \mathcal{G} \\ \iff P(G) &= \int_{\Omega} \left(\int_{\Omega} Z(\omega, \omega')P(d\omega) \right) \mathbf{1}_G(\omega')P(d\omega') \quad \forall G \in \mathcal{G} \end{aligned}$$

Samoin, $\int_{\Omega} Z(\omega, \omega')P(d\omega') \equiv 1$.

Huomautus 10.6.2. Tässä kappaleessa yleistettiin lause 10.5.1 ja esimerkki 10.6.1 tilanteeseen jossa \mathcal{H} ja \mathcal{G} ovat yleisiä ali- σ -algebrat eikä välttämättä satunnaisvektoreiden virittämiä.

10.7 Ehdollistaminen nollamittaisiin tapahtumiin: varoitus

Olkoon $X(\omega), Y(\omega)$ riippumattomia standardi gaussisia satunnaismuuttujia,

$$E_P(X) = E_P(Y) = 0, E_P(X^2) = E_P(Y^2) = 1. \text{ Olkoon}$$

$$W(\omega) = (X(\omega) - Y(\omega)), \quad Z(\omega) = \mathbf{1}(Y(\omega) \neq 0) \frac{X(\omega)}{Y(\omega)}$$

Olkoon $N = \{\omega : Y(\omega) = 0\}$. $P(N) = 0$ koska Gaussinen jakauma on absoluuttisesti jatkuva Lebesgue mitan suhteen jolla $\lambda(\{y\}) = 0 \forall y \in \mathbb{R}$, ja

$$N^c \cap \{\omega : X(\omega) = Y(\omega)\} = N^c \cap \{\omega : W(\omega) = 0\} = N^c \cap \{\omega : Z(\omega) = 1\}$$

Olkoon $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ rajoitettu Borel mitallinen kuvaus.

$$\begin{aligned} i) \quad E_P(f(X)|\{X = Y\}) &= \frac{\iint_{\mathbb{R} \times \mathbb{R}} f(x)\delta_0(x - y)p_X(x)p_Y(y)dx dy}{\iint_{\mathbb{R} \times \mathbb{R}} \delta_0(x - y)p_X(x)p_Y(y)dx dy} \\ ii) \quad E_P(f(X)|W = 0) &= \int_{\mathbb{R}} f(x)p_{X|W}(x|0)dx \\ iii) \quad E_P(f(X)|Z = 1) &= \int_{\mathbb{R}} f(x)p_{X|Z}(x|1)dx \end{aligned}$$

eivät ole valttämättä samasuuruisia, vaikka

$$\begin{aligned} \{\omega : X(\omega) = Y(\omega)\} \cap \{\omega : Y(\omega) \neq 0\} &= \{\omega : W(\omega) = 0\} \cap \{\omega : Y(\omega) \neq 0\} \\ &= \{\omega : Z(\omega) = 1\} \cap \{\omega : Y(\omega) \neq 0\}. \end{aligned}$$

Näytämme että $i) = ii) \neq iii)$.

$i)$ Perustuu tulkintaan

$$\begin{aligned} E_P(f(X)|\{X = Y\}) &:= \lim_{\varepsilon \downarrow 0} E_P(f(X)|\{|X - Y| < \varepsilon\}) \\ &= \lim_{\varepsilon \downarrow 0} \frac{E_P(f(X)\mathbf{1}\{|X - Y| < \varepsilon\})}{P(|X - Y| < \varepsilon)} = \lim_{\varepsilon \downarrow 0} \frac{\int_{\mathbb{R}} \left(\int_{x-\varepsilon}^{x+\varepsilon} p_Y(y)dy \right) f(x)p_X(x)dx}{\int_{\mathbb{R}} \left(\int_{x-\varepsilon}^{x+\varepsilon} p_Y(y)dy \right) p_X(x)dx} \\ &= \frac{\int_{\mathbb{R}} \lim_{\varepsilon \downarrow 0} \left((2\varepsilon)^{-1} \int_{x-\varepsilon}^{x+\varepsilon} p_Y(y)dy \right) f(x)p_X(x)dx}{\int_{\mathbb{R}} \lim_{\varepsilon \downarrow 0} \left((2\varepsilon)^{-1} \int_{x-\varepsilon}^{x+\varepsilon} p_Y(y)dy \right) p_X(x)dx} \\ &= \frac{\int_{\mathbb{R}} f(x)p_Y(x)p_X(x)dx}{\int_{\mathbb{R}} p_Y(x)p_X(x)dx} = \frac{\iint_{\mathbb{R} \times \mathbb{R}} f(x)\delta_0(x - y)p_X(x)p_Y(y)dx dy}{\iint_{\mathbb{R} \times \mathbb{R}} \delta_0(x - y)p_X(x)p_Y(y)dx dy} \end{aligned}$$

Tässä δ_0 on Diracin delta distribuutio jolla on ominaisuus

$$\int_{\mathbb{R}} g(x)\delta_0(x)dx = g(0) = \int_{\mathbb{R}} g(x)F(dx)$$

kaikille jatkuville funktioille g , ja $F(x) = \mathbf{1}(x \geq 0)$. Diracin δ on porrask-funktion F :n derivaatta distribution mielessä.

Lasketaan:

$$i) \quad \frac{\int_{\mathbb{R} \times \mathbb{R}} f(x) \delta_0(x-y) p_X(x) p_Y(y) dx dy}{\int_{\mathbb{R} \times \mathbb{R}} \delta_0(x-y) p_X(x) p_Y(y) dx dy} = \frac{\int_{\mathbb{R}} f(x) p_X(x) p_Y(x) dx}{\int_{\mathbb{R}} p_X(x) p_Y(x) dx} = \frac{\int_{\mathbb{R}} f(x) e^{-x^2} dx}{\int_{\mathbb{R}} e^{-x^2} dx} = \frac{1}{\sqrt{\pi}} \int_{\mathbb{R}} f(x) e^{-x^2} dx .$$

ii) Bayesin kaavasta

$$p_{X|W}(x, w) = \frac{p_X(x) p_{W|X}(x, w)}{p_W(w)} = \frac{p_X(x) p_{W|X}(x, w)}{p_W(w)} = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{1}{2}x^2\right) \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{1}{2}(w-x)^2\right) \left(\frac{1}{\sqrt{4\pi}} \exp\left(-\frac{1}{4}w^2\right)\right)^{-1}$$

koska $p_{W|X}(w|x) = p_Y(w-x)$ ja W on gaussinen ja $E(W) = E(X) - E(Y) = 0$, $E(W^2) = E(X^2) + E(Y^2)$, siis

$$p_{W|X}(w|x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{(w-x)^2}{2}\right)$$

joka on gaussisen jakauman $\mathcal{N}(x, 1)$ tiheysfunktio.

Tästä seuraa

$$\int_{\mathbb{R}} f(x) p_{X|W}(x|0) dx = \frac{1}{\sqrt{\pi}} \int_{\mathbb{R}} f(x) e^{-x^2} dx$$

joka täsmää i) arvon kanssa.

Kuitenkin

$$p_{Z|X}(z|x) = p_Y(x/z) \left| \frac{dy}{dz} \right| = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{x^2}{2z^2}\right) \frac{|x|}{z^2}$$

muuttujan vaihdolla $z = x/y$, ja

$$\begin{aligned} p_Z(z) &= \int_{\mathbb{R}} p_{Z|X}(z|x) p_X(x) dx = \frac{1}{z^2 2\pi} \int_{\mathbb{R}} |x| \exp\left(-\frac{x^2}{2}(1+z^{-2})\right) dx \\ &= \frac{1}{z^2 2\pi} 2 \int_0^{\infty} r^{1/2} \exp\left(-\frac{r}{2}(1+z^{-2})\right) \frac{r^{-1/2}}{2} dr \\ &= \frac{1}{z^2 2\pi} \int_0^{\infty} \exp\left(-\frac{r}{2}(1+z^{-2})\right) dr = \frac{1}{z^2 2\pi} \frac{2}{(1+z^{-2})} = \frac{1}{(1+z^2)\pi} \end{aligned}$$

muuttujan vaihdolla $r = x^2$. Tämän jakauman nimi on Student-t vapausasteella 1.

Tästä seuraa Bayesin kaavalla

$$\begin{aligned} p_{X|Z}(x|z) &= \frac{p_X(x)p_{Z|X}(x|z)}{p_Z(z)} = \frac{\frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp(-x^2/2) \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp(-\frac{x^2}{2z^2}) \frac{|x|}{z^2}}{(1+z^2)^{-1}\pi^{-1}} \\ &= \frac{(1+z^2)|x|}{2} \exp(-\frac{x^2}{2}(1+z^{-2})) \end{aligned}$$

Kun $z = 1$ saadaan $p_{X|Z}(x|1) = |x| \exp(-x^2)$ ja

$$E_P(f(X)|Z = 1) = \int_{\mathbb{R}} f(x)p_{X|Z}(x|1)dx = \int_{\mathbb{R}} f(x)|x| \exp(-x^2)dx$$

joka on eri kuin integraalien i) ii) arvo.

Nolla-mittaisilla tapahtumilla voi olla eri esityksiä eri satunnaismuuttujien avulla, ja vastaavien ehdollisten odotusarvojen pistettäiset arvot saattavat olla eriläisiä. Tämä ei ole ristiriidassa todennäköisyysteorian kanssa koska aina voidaan vaihtaa ehdollisen odotusarvon arvot pistettäin nolla mittaisissa joukoissa.

Luku 11

Martingaalit

Määritelmä 11.0.1. Olkoon (Ω, \mathcal{F}) todennäköisyysavaruus, ja $\mathbb{T} = \mathbb{N}, \mathbb{R}^+, \mathbb{Z}, \mathbb{R}, \mathbb{Q}, \mathbb{Q}^+, \dots$ aikaindeksien joukko.

Filtraatio $\mathbb{F} = (\mathcal{F}_t : t \in \mathbb{T})$ on σ -algebroiden kokoelma, joka on ajan suhteen ei-vähenevä:

$$\mathcal{F}_s \subseteq \mathcal{F}_t \subseteq \mathcal{F} \quad \forall 0 \leq s \leq t$$

Määritelmä 11.0.2. Stokastinen prosessi $(X_t(\omega) : t \in \mathbb{T})$ on sopiva (tai adaptoitu) filtraation \mathbb{F} :n suhteen, kun $X_t(\omega)$ on \mathcal{F}_t -mitallinen $\forall t \in \mathbb{T}$.

Määritelmä 11.0.3. Diskreetti ajassa, eli kun $\mathbb{T} \subseteq \mathbb{Z}$, stokastinen prosessi $(X_t(\omega) : t \in \mathbb{T})$ on ennustettava filtraation \mathbb{F} :n suhteen, kun $X_t(\omega)$ on \mathcal{F}_{t-1} -mitallinen $\forall t \in \mathbb{T}$.

Määritelmä 11.0.4. Sanotaan että stokastinen prosessi $X = (X_t : t \in \mathbb{T})$ on (ali,yli)-martingaali filtraation \mathbb{F} :n suhteen kun

1. (X_t) on \mathbb{F} -sopiva
2. $X_t \in L^1(\Omega, \mathcal{F}_t, P) \forall t \in \mathbb{T}$,
- 3.

$$E_P(M_t | \mathcal{F}_s) = M_s \quad \forall s \leq t,$$

vastaavasti \leq ylimartingaalin tapauksessa ja \geq alimartingaalin tapauksessa.

Huomataan että martingaalin ominaisuus riippuu sekä todennäköisyysmitasta että filtraatiosta. Ylimartingaali on ajan-suhteen ”keskimäärin” ei-kasvava, alimartingaali on ”keskimäärin” ei-vähenevä, martingaali on sekä ylimartingaali että alimartingaali.

Lemma 11.0.1. *Diskreetti ajassa ($\mathbb{T} \subseteq \mathbb{Z}$), määritelmässä 11.0.4 ominaisuus (3) seuraa kaikille $s \leq t$ kun*

$$E_P(M_t | \mathcal{F}_{t-1}) = M_{t-1} \quad \forall t$$

Tod. Induktiolla, kun $t = s$,

$$E_P(M_t | \mathcal{F}_s) = E_P(M_s | \mathcal{F}_s) = M_s$$

Muuten voidaan käyttää induktiota $r = (t - s)$:n suhteen, olettamalla että lemma on voimassa kaikille arvoille t, s joilla $(t - s) < r$, kun $(t - s) = r$ seuraa

$$\begin{aligned} E_P(M_t | \mathcal{F}_s) &= E_P(E_P(M_t | \mathcal{F}_{s+1}) | \mathcal{F}_s) \\ &= E_P(M_{s+1} | \mathcal{F}_s) = M_s \end{aligned}$$

Samoin voidaan tarkistaa myös ali- ja yli- martingaalin epäyhtälöitä.

Esimerkki 11.0.1. *Olkoon $(X_t : t \in \mathbb{N}) \subseteq L^1(P)$ riippumattomien satunnaismuuttujien jono jolla $E(X_t) = \mu \in \mathbb{R}$, ja olkoon $\mathcal{F}_t = \mathcal{F}_t^X := \sigma(X_1, X_2, \dots, X_t)$ $S_t = (X_1 + \dots + X_t)$ on \mathbb{F} -alimartingaali kun $\mu > 0$, ja \mathbb{F} -ylimartingaali kun $\mu < 0$, ja \mathbb{F} -martingaali kun $\mu = 0$.*

Esimerkki 11.0.2. *Olkoon $(X_t : t \in \mathbb{N})$ riippumattomien satunnaismuuttujien jono jolla $X_t(\omega) \geq 0$ P -m.v. ja $E(X_t) = \mu \in [0, +\infty)$, ja olkoon $\mathcal{F}_t = \sigma(X_1, X_2, \dots, X_t)$*

Silloin tuloprosessi $M_t = (X_1 X_2 \dots X_t)$ on \mathbb{F} -alimartingaali kun $\mu > 1$, ja \mathbb{F} -ylimartingaali kun $\mu < 1$, ja \mathbb{F} -martingaali kun $\mu = 1$.

Esimerkki 11.0.3. *Olkoon $X_t(\omega) \in \mathbb{R}^d$ $t \in \mathbb{N}$, diskreetti aikainen Markovin ketju alkujakaumalla $\pi(dx)$ ja siirtymäytimellä $K(x, dy)$.*

Olkoon $\mathcal{F}_t = \mathcal{F}_t^X = \sigma(X_0, X_1, \dots, X_t)$.

Määritellään operaattori

$$(Kf)(x) := \int_{\mathbb{R}^d} f(y)K(y, dx) = E_x(f(X_1)) = E_P(f(X_t)|X_{t-1} = x)$$

Osoita että

$$M_t(f) = \sum_{s=1}^t (f(X_s) - (Kf)(X_{s-1}))$$

on \mathbb{F} -martingaali kun $f(x)$ on rajoitettu ja Borel mitallinen.

Teleskoppisen summan esityksestä,

$$\begin{aligned} f(X_t) &= f(X_0) + \sum_{s=1}^t (f(X_s) - f(X_{s-1})) = \\ &= f(X_0) + \sum_{s=1}^t (f(X_s) - Kf(X_{s-1})) + \sum_{s=1}^t ((Kf)(X_{s-1}) - f(X_{s-1})) \\ &= f(X_0) + M_t(f) + A_t(f) \end{aligned}$$

saadaan Doobin hajotelma jossa $A_t(f)$ on ennustettava prosessi

Lause 11.0.1. Olkoon (X_t) martingaali ja (Y_t) ennustettava prosessi filtraation $(\mathcal{F}_t : t \in \mathbb{N})$ suhteen.

Määritellään martingaalimuunnos tai aika-diskreetti stokastinen integraali

$$M_t = \sum_{s=1}^t Y_s(X_s - X_{s-1}) = \sum_{s=1}^t Y_s \Delta X_s$$

Kun $E(|Y_s \Delta M_s|) < \infty \forall s \in \mathbb{N}$, (M_t) on martingaali.

Tod. Määritelmästä seuraa että M_t on \mathbb{F} -sopiva ja integroituvuus ehto seuraa kolmio epäyhtälöstä. Tarkistamme että martingaali-ominaisuus on voimassa:

$$E_P(M_t - M_{t-1} | \mathcal{F}_{t-1}) = E_P(Y_t(X_t - X_{t-1}) | \mathcal{F}_{t-1}) = Y_t E_P(X_t - X_{t-1} | \mathcal{F}_{t-1}) = 0$$

jossa käytettiin integrandin (Y_t) :n \mathbb{F} -ennustettavuutta.

Integroituvuus voidaan tarkistaa Hölderin epäyhtälöllä

$$E(|Y_s \Delta M_s|) \leq \|Y_s\|_{L_p} \|\Delta M_s\|_{L_q}$$

kun $p, q \in [1, +\infty]$ ovat konjugaatti-eksponentteja joilla $p^{-1} + q^{-1} = 1$.

Vedonlyönti-tulkinta Oletamme että hetkellä $(t - 1)$ on mahdollisuus ostaa tai myydä arpajaisia hinnalla X_{t-1} . Hetkellä t arpajaisen arvo on X_t , satunnaisvoittolla $\Delta X_t = (X_t - X_{t-1})$ (negatiivinen voitto tulkitaan on tappioksi). Tässä $Y_t(\omega)$ on vedonlyönti strategia, ennustettava siinä mielessä että on \mathcal{F}_{t-1} -mitallinen kun ΔX_t on \mathcal{F}_t -mitallinen, siis kun lyödään vetoa ei tiedetä mitä tapahtuu seuraavaksi. M_t on pelaajan pääoma ja

$$M_t - M_0 = \sum_{s=1}^t Y_s \Delta X_s$$

on pelaajan voitto. Reilussa pelissa $E_P(\Delta X_t | \mathcal{F}_{t-1}) = 0$ ja arpajaisen arvoprosessi on martingaali. Lause 11.0.1 kertoo että niin kauan kun integroituvuus-ehdot ovat voimassa ja pelistrategia on ennustettava, pelaajan voitto-prosessi on martingaali. Kun X_t on ylimartingaali (kuten roulette-pelissä), ja ennustettava pelistrategia on rajoitettu ja ei-negatiivinen, voittoprosessi on edelleen ylimartingaali.

Määritelmä 11.0.5. *Satunnais-hetki $\tau(\omega) \in \mathbb{T} = \mathbb{N}$ on (\mathcal{F}_t) -pysähdyshetki kun*

$$\{\omega : \tau(\omega) \leq t\} \in \mathcal{F}_t \quad \forall t \in \mathbb{N}$$

Jokaisella ajanhetkellä $t \in \mathbb{N}$, σ -algebran \mathcal{F}_t sisältämän informaation perusteella voidaan päättää onko $\tau(\omega)$ tapahtunut jo, vai se tapahtuu vasta tulevaisuudessa.

Satunnais hetki $\tau(\omega)$ on pysähdyshetki jos ja vain jos laskuri prosessi $N_t(\omega) = \mathbf{1}(\tau(\omega) \leq t)$ on (\mathcal{F}_t) -sopiva.

Tehtävä 11.0.1. *Jos $\tau(\omega)$ ja $\sigma(\omega)$ ovat (\mathcal{F}_t) -pysähdyshetkiä, siitä seuraa että niiden minimi $\tau(\omega) \wedge \sigma(\omega)$ ja maksimi $\tau(\omega) \vee \sigma(\omega)$ ovat myös (\mathcal{F}_t) -pysähdyshetkiä,*

Luku 12

Martingaalien konvergenssi

12.1 Doobin Martingaali-konvergenssi lause

Martingaali $(M_t : t \in \mathbb{N})$ joka on rajoitettu $L^1(P)$ normissa, suppenee P -melkein varmasti kun $t \rightarrow +\infty$.

Teoreema 12.1.1. (Doob) Olkoon $(X_t : t \in \mathbb{N})$ ylimartingaali jolla $\sup_{t \in \mathbb{N}} E_P(X_t^-) < \infty$, (tässä $x^- = \max(-x, 0)$). Silloin

$$\begin{aligned} \sup_{t \in \mathbb{N}} E_P(|X_t|) &< \infty \\ \lim_{t \rightarrow \infty} X_t(\omega) &= X_\infty(\omega) \quad P\text{-m.v.} \end{aligned}$$

jossa $X_\infty(\omega) \in L^1(\Omega)$

Huomautus : vaikka $X_\infty(\omega) \in L^1(P)$, kun $(X_t : t \in \mathbb{N})$ ei ole rajoitettu $L^1(P)$ normissa, $L^1(P)$ -konvergenssi ei välttämättä päde.

Tod. Koska X_t on ylimartingaali, $\forall t \in \mathbb{N}$

$$E(X_t^+) \leq E(X_0) + E(X_t^-)$$

joten

$$\sup_t E(X_t^+) \leq E(X_0) + \sup_t E(X_t^-)$$

jossa $E(|X_0|) < \infty$, siksi $(X_t)_{t \in \mathbb{N}}$ on rajoitettu $L^1(P)$ avaruudessa.

Olkoon $a < b$, ja määritellään pysähdyshetkien jono

$$\sigma_0(\omega) = \inf\{s \in \mathbb{N} : X_s(\omega) < a\}$$

(ensimmäinen a tason alituksen hetki)

$$\tau_i(\omega) = \inf\{s > \sigma_i(\omega) : X_s(\omega) \geq b\},$$

$$\sigma_i(\omega) = \inf\{s > \tau_{i-1}(\omega) : X_s(\omega) < a\}, \quad i \geq 1$$

joilla $0 \leq \sigma_i < \tau_i < \sigma_{i+1} < \dots$. Nämä ovat pysähdyshetkiä, koska $\forall t \in \mathbb{N}$ tapahtumat

$$\{\omega : \sigma_i(\omega) \leq t\} \quad \text{ja} \quad \{\omega : \tau_i(\omega) \leq t\}$$

riippuvat ainoastaan prosessin polusta $(X_1(\omega), \dots, X_t(\omega))$, ja siksi ovat \mathcal{F}_t -mitallisia. Määritellään sijoitusstrategia

$$C_t(\omega) = \begin{cases} 1 & t \in (\sigma_i, \tau_i] \text{ joillekin } i \in \mathbb{N} \\ 0 & t \in (\tau_i, \sigma_{i+1}] \end{cases}$$

Koska τ_i ja σ_i ovat pysähdyshetkiä, kaikille $t \in \mathbb{N}$

$$\{C_t = 1\} = \bigcup_{i \in \mathbb{N}} \{t \in (\sigma_i, \tau_i]\} = \bigcup_{i \in \mathbb{N}} \{\sigma_i \leq (t-1)\} \cap \{\tau_i \leq (t-1)\}^c \in \mathcal{F}_{t-1}$$

Koska $C_t(\omega) \in \{0, 1\}$ on ei-negatiivinen ja rajoitettu ennustettava prosessi, seuraa että martingaali muunnos

$$Y_t(\omega) = \sum_{s=1}^t C_s(\omega) \Delta X_s$$

on myös ylimartingaali, erityisesti $E(Y_t) \leq E(Y_0) = 0$. Olkoon

$$U_{[a,b]}([0, t]) := \#\{i : \tau_i(\omega) \leq t\} =$$

”montako kertaa aikavälissä $[0, t]$, prosessin polku $X_s(\omega)$ on ylittänyt b -tasoa aloittamalla a -tason alapuolelta” .

Ennustettavalla sijoitustrategialla C_t , jokaisesta tason $[a, b]$ välin ylityksestä alhaalta ylöspäin kertyy sijoittajalle vähintään $(b-a) > 0$ verran voittoa, ja viimeisen ylityksen jälkeen on kertynyt korkeintaan $(X_t - a)^-$ tappiota. Koska

$$Y_t \geq (b-a)U_{[a,b]}([0, t]) - (X_t - a)^-$$

ja koska $E(Y_t) \leq E(Y_0) = 0$, seuraa Doobin ylitysten-epäyhtälö (*upcrossing-inequality*)

$$E_P(U_{[a,b]}([0, t])) \leq \frac{1}{(b-a)} E_P((X_t - a)^-)$$

Koska $U_{[a,b]}([0, t])$ on ei-vähenevä, $\forall \omega$ on olemassa

$$\begin{aligned} U_{[a,b]}([0, \infty), \omega) &:= \lim_{t \rightarrow \infty} U_{[a,b]}([0, t]) \in \mathbb{N} \cup \{+\infty\} \\ (X_t - a)^- &= \max(a - X_t, 0) \leq |a| + X_t^- \end{aligned}$$

seuraa monotonisen konvergenssin lauseesta

$$E_P(U_{[a,b]}([0, \infty))) = \lim_{t \rightarrow \infty} E_P(U_{[a,b]}([0, t])) \leq \frac{1}{(b-a)} \left(|a| + \sup_{t \in \mathbb{N}} E_P(X_t^-) \right) < \infty$$

Erityisesti $U_{[a,b]}([0, \infty), \omega) < \infty$ P -melkein varmasti. Tapahtuma

$$\begin{aligned} N &= \left\{ \omega : \liminf_{t \rightarrow \infty} X_t(\omega) \not\leq \limsup_{t \rightarrow \infty} X_t(\omega) \right\} \\ &= \bigcup_{a < b \in \mathbb{Q}} \left\{ \omega : \liminf_{t \rightarrow \infty} X_t(\omega) \leq a < b \leq \limsup_{t \rightarrow \infty} X_t(\omega) \right\} \\ &= \bigcup_{a < b \in \mathbb{Q}} \left\{ U_{[a,b]}([0, \infty), \omega) = \infty \right\} \end{aligned}$$

on P -nolla tapahtumien numeroituva yhdiste, joten $P(N) = 0$.

Tämä tarkoittaa että P -melkein varmasti $(X_t(\omega))_{t \in \mathbb{N}}$ suppenee kohti raja-arvoa $X_\infty(\omega) := \limsup_{t \rightarrow \infty} X_t(\omega)$, $\forall \omega \in \Omega$. A priori $X_\infty(\omega) \in [-\infty, \infty]$, mutta Fatoun lemmasta seuraa

$$E(|X_\infty|) = E(\liminf_t |X_t|) \leq \liminf_t E(|X_t|) \leq \sup_t E(|X_t|) < \infty,$$

siksi $|X_\infty(\omega)| < \infty$ P -melkein varmasti \square .

Seuraus 12.1.1. Olkoon $(X_t : t \in \mathbb{N})$ alimartingaali jolla $E_P(X_t^+) < \infty$. Silloin, P -melkein varmasti $\exists \lim_{t \rightarrow \infty} X_t(\omega) = X_\infty(\omega) \in L^1(P)$.

Tod. Doobin konvergenssi lause soveltuu ylimartingaalille $(-X_t)$.

Seuraus 12.1.2. Kun X_t on ei-negatiivinen ylimartingaali, on olemassa P -melkein varmasti raja-arvo $X_\infty(\omega) := \lim_{t \rightarrow \infty} X_t(\omega) \geq 0$ jolla $E_P(X_\infty | \mathcal{F}_t)(\omega) \leq X_t(\omega) \forall t < \infty$.

Tod. Doobin martingaalikonvergenssilause soveltuu koska $X_t^- (\omega) \equiv 0$. Fatou lemmasta ehdolliselle odotusarvolle

$$\begin{aligned} E_P(X_\infty | \mathcal{F}_t) &= E_P(\liminf_u X_u | \mathcal{F}_t) \\ &\leq \liminf_u E_P(X_u | \mathcal{F}_t) \leq X_t \end{aligned}$$

(X_t) on ylimartingaali laajennetulla indeksijoukolla $\mathbb{N} \cup \{+\infty\}$ \square

12.1.1 Tasaisesti integroituvat martingaalit

Lause 12.1.1. Olkoon satunnaismuuttuja $X(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$. Kokoelma

$$\{E_P(X | \mathcal{G})(\omega) : \mathcal{G} \subseteq \mathcal{F} \text{ ali } \sigma\text{-algebra}\}$$

on tasaisesti integroitua.

Tod. Koska $\{X\} \subseteq L^1(P)$ on tasaisesti integroitua, $\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0$ jolla $E_P(|X| \mathbf{1}_A) < \varepsilon$ kun $P(A) < \delta$.

Olkoon $Y(\omega) = E_P(X | \mathcal{G})(\omega)$, seuraa että $E_P(|Y|) \leq E_P(|X|) < \infty$

$$KP(|Y| > K) \leq E_P(|Y|) \leq E_P(|X|)$$

josta seuraa $P(|Y| > K) < \delta$ kun $K > E_P(|X|)\delta^{-1}$, ja

$$\begin{aligned} \varepsilon &\geq E_P(|X| \mathbf{1}(|Y| > K)) = E_P(E_P(|X| | \mathcal{G}) \mathbf{1}(|Y| > K)) \\ &\geq E_P(|Y| \mathbf{1}(|Y| > K)) \end{aligned}$$

on voimassa samaan aikaan kaikille ali σ -algebroille $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$.

Seuraus 12.1.3. Olkoon satunnaismuuttuja $X(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$, ja $\mathbb{F} = (\mathcal{F}_t : t \in \mathbb{T})$ filtraatio. Silloin

$$M_t(\omega) = E_P(X | \mathcal{F}_t)(\omega) \quad t \in \mathbb{T}$$

on tasaisesti integroitua martingaali.

Teoreema 12.1.2. • \mathbb{F} -martingaali $(M_t : t \in \mathbb{N})$ on tasaisesti integroituva jos ja vain jos on olemassa satunnaismuuttuja $M_\infty(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{F}_\infty, P)$

jossa $\mathcal{F}_\infty := \bigvee_{t \in \mathbb{N}} \mathcal{F}_t$ ja

$M_t(\omega) \rightarrow M_\infty(\omega)$ P -melkein varmasti ja $L^1(P)$ mielessä.

- Kun \mathbb{F} -martingaali $(M_t : t \in \mathbb{N})$ on ei-negatiivinen, erityisesti se on ei-negatiivinen ylimartingaali, seuraa lauseesta 12.1.2 että on olemassa $M_\infty(\omega) \in L^1(P)$ jolla $M_t(\omega) \rightarrow M_\infty(\omega)$ P -melkein varmasti ja $E_P(M_\infty | \mathcal{F}_t)(\omega) \leq M_t(\omega) \quad \forall t \in \mathbb{N}$.

Silloin $(M_t : t \in \mathbb{N})$ on tasaisesti integroituva ja $M_t(\omega) = E_P(M_\infty | \mathcal{F}_t)(\omega)$ jos ja vain jos $E_P(M_0) = E_P(M_\infty)$.

Tod. Koska $(M_t : t \in \mathbb{N})$ on rajoitettu $L^1(P)$:ssa koska on tasaisesti integroituva ja

$$\sup_t E_P(|M_t|) \leq K + \sup_{t \in \mathbb{N}} E_P(|X_t| \mathbf{1}(|X_t| > K)) < \infty.$$

Doobin martingaali konvergenssi lause soveltuu

$$\lim_{t \rightarrow \infty} M_t(\omega) = M_\infty(\omega) \quad P\text{-m.v.}$$

jossa määritellään $\forall \omega$

$$M_\infty(\omega) := \liminf_{t \rightarrow \infty} M_t(\omega)$$

$L^1(P)$ konvergenssin karakterisaatiosta seuraa että $M_t \xrightarrow{L^1(P)} M_\infty$.

Olkoon $A \in \mathcal{F}_t$, koska $(M_t(\omega) \mathbf{1}_A(\omega) : t \in \mathbb{N})$ on tasaisesti integroituva, seuraa kun $\forall u \geq t$

$$E_P(M_t \mathbf{1}_A) = E_P(M_u \mathbf{1}_A) \rightarrow E_P(M_\infty \mathbf{1}_A) \text{ kun } u \uparrow \infty \quad \forall A \in \mathcal{F}_t$$

joka tarkoittaa $E_P(M_\infty | \mathcal{F}_t)(\omega) = M_t(\omega)$.

Kun (M_t) on ei-negatiivinen martingaali, seuraa että

$$M_t - E_P(M_\infty | \mathcal{F}_t) \geq 0$$

jos

$$0 = E_P(M_t) - E_P(M_\infty) = E_P(M_t - E_P(M_\infty|\mathcal{F}_t))$$

seuraa että

$$M_t = E_P(M_\infty|\mathcal{F}_t)$$

ja se on tasaisesti integroituva.

Huomautus ($M_t : t \in \mathbb{N}$) on tasaisesti integroituva martingaali, jos ja vain jos (M_t) on martingaali laajennetussa aikaindeksijoukolla $\mathbb{N} \cup \{+\infty\}$.

Esimerkki 12.1.1. Olkoon $X_t(\omega) \geq 0$ ja P -riippumattomia, joilla $E_P(X_t) = 1$ $\forall t \in \mathbb{N}$. Silloin $M_t(\omega) = X_1(\omega)X_2(\omega) \dots X_t(\omega)$ on \mathbb{F} -martingaali jossa $\mathcal{F}_t = \sigma(X_1, \dots, X_t)$.

Koska M_t on ei-negatiivinen ylimartingaali, seuraa että P -melkein varmasti $\lim_{t \rightarrow \infty} M_t(\omega) = M_\infty(\omega) \in L^1(P)$, ja $M_t(\omega) \geq E_P(M_\infty|\mathcal{F}_t)(\omega)$.

Jos ($M_t : t \in \mathbb{N}$) on tasaisesti integroituva, seuraa $M_t(\omega) = E_P(M_\infty|\mathcal{F}_t)(\omega)$.

12.1.2 Martingaalin takaperäinen konvergenssi

Olkoon ($\mathcal{F}_t : t \in -\mathbb{N}$) filtraatio. Kun $-\infty \leq s \leq t \leq 0$

$$\mathcal{F} \supseteq \mathcal{F}_t \supseteq \mathcal{F}_s \supseteq \mathcal{F}_{-\infty} := \bigcap_{t \in -\mathbb{N}} \mathcal{F}_t$$

jossa $\mathcal{F}_{-\infty}$ on häntä σ -algebra.

Teoreema 12.1.3. (Doobin martingaalin takaperäinen konvergenssilause) Olkoon ($X_t : t \in -\mathbb{N}$) ylimartingaali filtraatiossa ($\mathcal{F}_t : t \in -\mathbb{N}$).

Tarkastellaan mitä tapahtuu kun $t \downarrow (-\infty)$ ja informaatio pienenee.

1. P -melkein varmasti on olemassa raja-arvo

$$X_{-\infty}(\omega) = \lim_{t \rightarrow -\infty} X_t(\omega) \in [-\infty, \infty)$$

2. Kun

$$\sup_{t \leq 0} E(X_t^+) < +\infty$$

seuraa että $X_{-\infty}(\omega) \in L^1(P)$.

3. Kun $(X_t : t \in -\mathbb{N})$ on martingaali, koska $X_t = E_P(X_0 | \mathcal{F}_t) \forall t \in -\mathbb{N}$ se on tasaisesti integroitava ja

$$X_{-\infty}(\omega) = E(X_0 | \mathcal{F}_{-\infty})(\omega)$$

eli martingaalin ominaisuus on voimassa laajennetussa aika-indeksi joukossa $\{-\infty\} \cup \mathbb{Z}$, ja $\lim_{t \rightarrow -\infty} X_t = X_{-\infty}$ myös $L^1(P)$ konvergenssin mielessä.

Todistus Olkoon $U_{(a,b)}([t, 0])$ prosessin (X_t) :n (a, b) -ylitysten määrä aikavälissä $[t, 0]$, jossa $a < b \in \mathbb{R}, t \in -\mathbb{N}$.

Olkoon $C_t(\omega) \in \{0, 1\}$ sama ennustettava pelistrategia kuten Doobin etuperäisessä martingaalikonvergenssilauseessa, ja

$$Y_u - Y_t = \sum_{r=t+1}^u C_r \Delta X_r \quad t \leq u \leq 0$$

on ylimartingaali aikaparemetrillä $u \in \{t, t+1, \dots, 0\}$. Kun $t < u = 0$

$$Y_0(\omega) - Y_t(\omega) \geq U_{(a,b)}([t, 0], \omega) - (Y_0(\omega) - a)^-$$

$E(Y_0 - Y_t) \leq 0$ koska (Y_t) on alimartingaali, josta seuraa

$$E_P(U_{[a,b]}([t, 0])) \leq \frac{E_P((X_0 - a)^-)}{(b - a)} \leq \frac{(|a| + E_P(|X_0|))}{(b - a)}$$

ja kuten etuperäisessä martingaalikonvergenssilauseessa

$$X_{-\infty}(\omega) := \limsup_{t \rightarrow -\infty} X_t(\omega) = \liminf_{t \rightarrow -\infty} X_t(\omega) \quad P\text{-m.v.}$$

Kun X_t on martingaali, on tasaisesti integroitava ja siitä seuraa konvergenssi $L^1(P)$ mielessä.

Alimartingaalin tapauksessa, koska $X_t \leq E(X_0 | \mathcal{F}_t)$ kun $t < 0$, seuraa

$$X_t^+ \leq E(X_0 | \mathcal{F}_t)^+ \leq E(X_0^+ | \mathcal{F}_t)$$

ja Fatou lemmasta seuraa

$$\begin{aligned} E(|X_{-\infty}|) &\leq \liminf_t E_P(X_t^+) + \liminf_t E_P(X_t^-) \\ &\leq E_P(|X_0|) + \sup_t E_P(X_t^-) \end{aligned}$$

Olkoon $A \in \mathcal{F}_{-\infty} \subseteq \mathcal{F}_t \forall t \in -\mathbb{N}$. Koska $(X_t = E_P(X_0 | \mathcal{F}_t) : t \in -\mathbb{N})$ on tasaisesti integroitava martingaali, $L^1(P)$ -konvergenssin karakterisointin nojalla voidaan ottaa raja-arvoa odotusarvon sisään kun tarkistamme ehdollisen odotusarvon määritelmää, eli

$$E_P(X_0 \mathbf{1}_A) = E_P(X_t \mathbf{1}_A) \rightarrow E_P(X_{-\infty} \mathbf{1}_A) \quad \forall A \in \mathcal{F}_{-\infty}$$

joka tarkoittaa $X_{-\infty} = E_P(X_t | \mathcal{F}_{-\infty})$.

Teoreema 12.1.4. (*Kolmogorovin vahva suurten lukujen laki*)

Olkoon $(X_t(\omega) : t \in \mathbb{N})$ P -riippumattomia ja samoin jakautuneita satunnaismuuttujia jossa $X_1 \in L^1(P)$, ja

$$S_t(\omega) = X_1(\omega) + \cdots + X_t(\omega) .$$

Silloin

$$\lim_{t \rightarrow \infty} t^{-1} S_t(\omega) = E_P(X_1) \quad P\text{-melkein varmasti ja } L^1(P)\text{:n mielessä.}$$

Todistus Olkoon $(\mathcal{F}_{-t} : t \in \mathbb{N})$ filtraatio jossa kun $t \geq 0$

$$\mathcal{F}_{-t} = \sigma(S_t, S_{t+1}, \dots),$$

ja martingaali $(M_{-t} : t \in \mathbb{N})$ jossa

$$M_{-t} = E_P(X_1 | \mathcal{F}_{-t})$$

Huomataan että σ -algebran \mathcal{F}_{-t} :n sisältämä informaatio vähenee kun $t \uparrow \infty$.

Symmetrisyyden nojalla satunnaisparit (S_t, X_r) ja (S_t, X_1) ovat samoin jakautuneita kun $1 \leq r \leq t$, ja P -riippumattomuudesta seuraa kun $t \geq 0$

$$\begin{aligned} M_{-t} &:= E_P(X_1 | \mathcal{F}_{-t}) = E_P(X_1 | S_t, S_{t+1}, S_{t+2}, \dots) \\ &= E_P(X_1 | S_t, X_{t+1}, X_{t+2}, \dots) = E_P(X_1 | \sigma(S_t)) = E_P(X_r | \sigma(S_t)) \quad \forall 1 \leq r \leq t \end{aligned}$$

eli

$$S_t = E_P(X_1 + \cdots + X_t | \sigma(S_t)) = \sum_{r=1}^t E_P(X_r | \sigma(S_t)) = t E_P(X_1 | \sigma(S_t))$$

ja $M_{-t}(\omega) = S_t(\omega)/t$ kun $t \geq 0$. Doobin takaperäisestä martingaali-konvergenssi lauseesta seuraa P -melkein varmasti ja $L^1(P)$ mielessä on olemassa raja-arvo

$$M_{-\infty}(\omega) = \lim_{t \rightarrow \infty} t^{-1} S_t(\omega) = M_{-\infty}(\omega) \quad P \text{ m.v.}$$

jossa

$$M_{-\infty}(\omega) := \liminf_{t \rightarrow \infty} t^{-1} S_t(\omega) \quad \forall \omega$$

Huomataan myös että $\forall \omega \in \Omega, \forall n \in \mathbb{N}$

$$\begin{aligned} \liminf_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} S_t(\omega) &= \liminf_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} \sum_{i=1}^n X_i(\omega) + \liminf_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} \sum_{i=(n+1)}^t X_i(\omega) \\ &= 0 + \liminf_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} \sum_{i=(n+1)}^t X_i(\omega) \end{aligned}$$

on $\mathcal{T}_{-n} = \sigma(X_n, X_{n+1}, \dots)$ -mitallinen $\forall n$, on mitallinen häntä σ -algebran $\mathcal{T}_{-\infty}$ suhteen (12.1.2), ja koska $(X_t)_{t \in \mathbb{N}}$ ovat P -riippumattomia Kolmogorovin 0 – 1 lemmasta, seuraa että satunnaismuuttuja $M_{-\infty}(\omega)$ on P -triviaali: $P(t \leq M_{-\infty}) \in \{0, 1\} \forall t$ ja $P(M_{-\infty} < \infty) = 1$, eli $P(M_{-\infty} = c) = 1$ jossa $c = \inf\{t : P(t \leq M_{-\infty}) = 1\}$.

Siis P -melkein varmasti ja $L^1(P)$ mielessä

$$\frac{1}{t} S_t(\omega) \rightarrow c = E_P(X_1 | \mathcal{F}_{-\infty})(\omega)$$

Ottaamalla odotusarvoa seuraa

$$c = E_P(M_{-\infty}) = E_P(E_P(X_1 | \mathcal{F}_{-\infty})) = E_P(X_1).$$

Huomautus Symmetrian seurauksena $t^{-1} S_t(\omega) = E_P(X_1 | \sigma(S_t))(\omega)$, ja sen P -melkein varma ja $L^1(P)$ -konvergenssista seurasi taperäisestä martingaali-konvergenssi lauseesta. Riippumattomuutta tarvittiin osoittaakseen että

$$E_P(X_1 | \sigma(S_t))(\omega) = E_P(X_1 | \sigma(S_t, S_{t+1}, S_{t+2} \dots))(\omega)$$

ja että raja-arvo on P -triviaali. Kun luovutaan rippumattomuudesta, raja-arvo on satunnainen. Siihen pohjautuu De Finettin lause. Bruno De Finetti (1906-1985) oli italialainen matemaatikko, taloustieteilijä ja tiedefilosofi.

12.2 Vaihdettavuus ja De Finettin lause

Määritelmä 12.2.1. *Satunnaisjono $(X_t)_{t \in \mathbb{N}}$ joka saa arvot todennäköisyysavaruudessa (S, \mathcal{S}) on äärettömään vaihdettavissa (engl. infinitely exchangeable) kun $\forall n, t_1, \dots, t_n \in \mathbb{N}$ ja indeksien $\{1, \dots, n\}$ permutaatio π , satunnaisvektorit $(X_{t_1}, \dots, X_{t_n})$ ja $(X_{t_{\pi(1)}}, \dots, X_{t_{\pi(n)}})$ ovat samoin jakautuneita P mitan suhteen.*

Huomataan että kun jono $(X_t)_{t \in \mathbb{N}}$ saa arvot \mathbb{R} :ssa, kuuten riippumattomien ja samoin jakautuneiden satunnaismuuttujien tapauksessa

$$M_{-t}(\omega) = t^{-1} S_t(\omega) := E(X_1 | \mathcal{T}_{-t}), \quad t \in \mathbb{N}$$

on martingaali jolla on martingaali jolla on raja-arvo P -melkein varmasti ja $L^1(P)$:mielessä kun $t \rightarrow \infty$

$$M_{-\infty}(\omega) = E(X_1 | \mathcal{T}_{-\infty})(\omega)$$

Häntä σ -algebra $\mathcal{T}_{-\infty}$ ei tarvitse olla triviaali ja $M_{-\infty}(\omega)$ on aidosti satunnainen.

Määritelmä 12.2.2. *Satunnaismuuttujat $(X_t(\omega) : t \in \mathbb{N})$ jotka saavat arvoja ja todennäköisyysavaruudessa (S, \mathcal{S}) ovat ehdollisesti riippumattomia ja samoin jakautuneita ehdolla σ -algebraa \mathcal{G} kun $\forall n, t_1, \dots, t_n, A_1 \dots A_n \in \mathcal{S}$.*

$$P(X_{t_1} \in A_1, \dots, X_{t_n} \in A_n | \mathcal{G})(\omega) = \prod_{i=1}^n P(X_{t_i} \in A_i | \mathcal{G})(\omega) \quad P \text{ m.v.}$$

Ottaamalla ehdollisen odotusarvon odotusarvoa, seuraa että ehdollisesti riippumattomia ja samoin jakautuneita satunnaismuuttujat ovat äärettömään vaihdettavissa.

Teoreema 12.2.1. *(De Finetti) Olkoon (S, \mathcal{S}) Borelin avaruus. Kun satunnaisjono $(X_t(\omega) : t \in \mathbb{N}) \subseteq S$ on äärettömästi vaihdettavissa P :n suhteen toinen implikaatio on myös voimassa, satunnaismuuttujat ovat ehdollisesti riippumattomia ja samoin jakautuneita ehdolla häntä- σ -algebraa $\mathcal{T}_{-\infty}$ joka tullaan määrittelemään.*

Proof Olkoon

$$\mu_t(dx; \omega) = t^{-1} \sum_{i=1}^t \mathbf{1}(X_i(\omega) \in dx)$$

satunnaismuuttujen (X_1, \dots, X_t) empiirinen mitta joka virittää σ -algebran $\sigma(\mu_t) = \sigma\{\mu_t(A) : A \in \mathcal{S}\} \subseteq \mathcal{F}$.

Huomataan että $\sigma(\mu_t) \subseteq \sigma(X_1, \dots, X_t)$, ja kun $t > 1$ se on aidosti pienempi koska empiirinen mitta sisältää satunnaismuuttujen arvot mutta unohtaa niiden järjestyksen.

Määritellään vähenevä σ -algebroiden jono

$$\mathcal{T}_{-t} := \bigvee_{k \geq t} \sigma(\mu_k), \quad \mathcal{T}_{-\infty} = \bigcap_{t \in \mathbb{N}} \mathcal{T}_{-t}, \text{ on häntä-}\sigma\text{-algebra.}$$

Olkoon $k \in \mathbb{N}$ ja $f(x_1, \dots, x_k) : S^k \rightarrow \mathbb{R}$ rajoitettu ja mitallinen funktio. Kun $t \geq k$ laskemme symmetrian avulla $E_P(f(X_1, \dots, X_k) | \mathcal{T}_{-t})(\omega)$.

Olkoon $1 \leq k \leq t$ ja määritellään satunnaistodennäköisyysmitta

$$\mu_t^{\circ k} : \mathcal{S}^{\otimes k} \rightarrow [0, 1]$$

joka on säännöllinen versio satunnaisvektorin (X_1, \dots, X_k) ehdollisesta jakaumasta ehdolla $\sigma(\mu_t)$ (joka on olemassa koska (S, \mathcal{S}) on Borelin avaruus).

Symmetriasta seuraa

$$\begin{aligned} & E_P(f(X_1, \dots, X_k) | \sigma(\mu_t))(\omega) \\ &= \mu_t^{\circ k}(f; \omega) := \int_{S^k} f(x) \mu_t^{\circ k}(dx; \omega) = \frac{1}{t!} \sum_{\pi} f(X_{\pi(1)}(\omega), \dots, X_{\pi(k)}(\omega)) \\ &= \frac{(t-k)!}{t!} \sum_{1 \leq i_1, \dots, i_k \leq t} f(X_{i_1}, X_{i_2}, \dots, X_{i_k}) \end{aligned}$$

eriläisiä

jossa summa otetaan yli $\{1, \dots, t\}$ joukon permutaatioita π .

Huomataan että $\mu_t^{\circ k}(dx; \omega)$ on $\sigma(\mu_t)$ -mitallinen, koska riippuu vain arvoista $\{X_1(\omega), \dots, X_t(\omega)\}$ eikä niiden järjestyksestä. Huomataan myös että $\mu_t^{\circ k}(dx)$ ei ole tulo mitta, koska summassa ei ole toistuvien indeksien termejä.

Huomataan myös että kun $k = 1$

$$\mu_t^{\circ 1}(A) = \mu_t(A) = \frac{1}{t} \sum_{k=1}^t \mathbf{1}(X_k \in A)$$

on otoksen $(X_1(\omega), \dots, X_t(\omega))$:n empiirinen mitta.

Kun $k \leq t$ vaihdettavuuden nojalla kaikille $\{1, \dots, t\}$ joukon permutaatiolle π (X_1, \dots, X_k, μ_t) ja $(X_{\pi(1)}, \dots, X_{\pi(k)}, \mu_t)$ ovat samoin jakutuneita, josta seuraa

$$E_P(f(X_1, \dots, X_k | \sigma(\mu_t)))(\omega) = E_P(f(X_{\pi(1)}, \dots, X_{\pi(k)} | \sigma(\mu_t)))(\omega)$$

Kun summataan permutaatioiden π :n yli ja jaetaan niiden määrällä saadaan

$$\mu_t^{\circ k}(f; \omega) = E_P(f(X_1, \dots, X_k | \sigma(\mu_t)))(\omega)$$

Osoitamme seuraavaksi

$$E_P(f(X_1, \dots, X_k | \sigma(\mathcal{T}_{-t})))(\omega) = E_P(f(X_1, \dots, X_k | \sigma(\mu_t)))(\omega)$$

Huomaamme myös että

$$\mathcal{T}_{-t} = \sigma(\mu_t, \mu_{t+1}, \mu_{t+2}, \dots) = \sigma(\mu_t, X_{t+1}, X_{t+2}, \dots)$$

koska empiiriset mitat $\mu_t(dx; \omega)$ ja $\mu_{t+1}(dx; \omega)$ määrävät $X_{t+1}(\omega)$ yhtälössä

$$(\mu_{t+1} - \mu_t)(dx) = \frac{1}{t+1} \left(\mathbf{1}(X_{t+1} \in dx) - \mu_t(dx) \right)$$

Then from infinite exchangeability it follows that in law, for $m \in \mathbb{N}$

$$\begin{aligned} & (X_1, X_2, \dots, X_n, X_{n+1}, X_{n+2}, \dots, X_{n+m}) \\ & \stackrel{\mathcal{L}}{=} (X_{\pi(1)}, X_{\pi(2)}, \dots, X_{\pi(n)}, X_{n+1}, X_{n+2}, \dots, X_{n+m}) \end{aligned}$$

for any permutation π of $\{1, \dots, n\}$.

Esimerkki 12.2.1. (X_1, \dots, X_n) ja $(X_{n+1}, X_{n+2}, \dots)$ ovat ehdollisesti riippumattomia ehdolla $\sigma(\mu_n)$,

R. Huomataan ensin että satunnaismuuttuja $W(\omega)$ on $\sigma(\mu_n)$ mitallinen jos ja vain jos $W(\omega) = g(X_1, \dots, X_n)$ jossa g on mitallinen ja symmetrinen, eli

$$g(x_1, \dots, x_m) = g(x_{\pi(1)}, \dots, x_{\pi(m)}) \quad \forall \pi \text{ permutaatiolle .}$$

Oletaamme myös että g on rajoitettu.

Olkoon myös $Y(\omega)$ rajoitettu ja $\sigma(X_{n+1}, X_{n+2}, \dots)$ -mitallinen, ja $f(x_1, \dots, x_n)$ rajoitettu $\mathcal{S}^{\otimes n}$ mitallinen, (ei välttämättä symmetrinen) Jonon äärettömästä vaihdettavuudesta seuraa $\forall n \in \mathbb{N}$ ja kaikille $\{1, \dots, n\}$ indeksien permutaatioille π , jonot

$$(X_1, X_2, \dots, X_n, X_{n+1}, X_{n+1}, \dots) \stackrel{\mathcal{L}}{=} (X_{\pi(1)}, X_{\pi(2)}, \dots, X_{\pi(n)}, X_{n+1}, X_{n+1}, \dots)$$

ovat samoin jakautuneita P -mitan suhteen

$$\begin{aligned} & E_P(Y W f(X_1, \dots, X_n)) E_P(Y g(X_1, \dots, X_n) f(X_1, \dots, X_n)) \\ &= E_P(Y g(X_{\pi(1)}, \dots, X_{\pi(n)}) f(X_{\pi(1)}, \dots, X_{\pi(n)})) \\ &\quad (\text{koska jono on vaihdettavissa}) \\ &= E_P(Y g(X_1, \dots, X_n) f(X_{\pi(1)}, \dots, X_{\pi(n)})) = E_P(Y W f(X_{\pi(1)}, \dots, X_{\pi(n)})) \\ &\quad (\text{koska } g \text{ on symmetrinen}) \\ &= \frac{1}{n!} \sum_{\pi} E_P \left(Y W f(X_{\pi(1)}, \dots, X_{\pi(n)}) \right) = E_P \left(Y W \frac{1}{n!} \sum_{\pi} f(X_{\pi(1)}, \dots, X_{\pi(n)}) \right) \\ &= E_P(Y W \mu_n^{\circ n}(f)) \end{aligned}$$

Ehdollinen odotusarvon määritelmästä seuraa että

$$E_P(f(X_1, \dots, X_n) | \sigma(\mu_n, X_{n+1}, X_{n+2}, \dots))(\omega) = \mu_n^{\circ n}(f; \omega) = E_P(f(X_1, \dots, X_n) | \sigma(\mu_n))(\omega)$$

eli (X_1, \dots, X_n) ja $(X_{n+1}, X_{n+2}, \dots)$ ovat ehdollisesti P -riippumattomia ehdolla $\sigma(\mu_n)$.

Toisin sanoen, \mathcal{T}_{-n} ei sisällä informaatiota jono ensimmäisten n -arvojen järjestyksestä.

Koska $M_{-t}^{(k)}(f) := \mu_t^{\circ k}(f)$ on martingaali filtratiossa $(\mathcal{T}_{-t} : t \in \mathbb{N})$, Doobin takaperäisestä martingaalikongvergenssi lauseesta seuraa että kun $t \rightarrow \infty$, on olemassa rajaarvo $M_{-\infty}^{(k)}(f)$ P -melkein varmasti ja $L^1(P)$:ssa.

Koska (X_1, \dots, X_k) saa arvot Borel avaruudessa, ehdollisella todennäköisyydellä

$$P((X_1, \dots, X_k) \in A | \mathcal{T}_{-\infty})(\omega), \quad A \in \mathcal{S}^{\otimes k}$$

on säännöllinen versio,

eli $\mathcal{T}_{-\infty}$ -mitallinen todennäköisyysydin $\mu_{\infty}^{\circ k}(dx; \omega)$ on $(S_1 \times \cdots \times S_k)$ jolla P -melkein varmasti kaikille rajoitetuille ja mitalliseille funktioille

$$\begin{aligned} M_{-\infty}^{(k)}(f; \omega) &= E_P(f(X_1, \dots, X_k) | \sigma(\mathcal{T}_{-\infty}))(\omega) \\ &= \int_{S_1, \dots, S_k} f(x_1, \dots, x_k) \mu_{\infty}^{\circ k}(dx_1, \dots, dx_k; \omega) \end{aligned}$$

Kun $k = 1$ merkitään $\mu_{\infty} = \mu_{\infty}^{\circ 1}$, jossa

$$\lim_{t \rightarrow \infty} \frac{1}{t} \sum_{i=1}^t f(X_i(\omega)) = \int_S f(x) \mu_{\infty}(dx, \omega) \quad P\text{-m.v.}$$

Esimerkki 12.2.2. Koska (S, \mathcal{S}) on Borelin avaruus, on olemassa mitallinen injektio $f : (S, \mathcal{S}) \rightarrow ([0, 1], \mathcal{B}([0, 1]))$ jolla on mitallinen käänteiskuvaus f^{-1} . Tästä seuraa että kun $A \subseteq S$, $A \in \mathcal{S}$ jos ja vain jos $f(A)$ on Borelin joukko. Koska

$$\sigma\{(a, b] : 0 \leq a < b \leq 1, a, b \in \mathbb{Q}\} = \mathcal{B}([0, 1])$$

seuraa että myös \mathcal{S} on numeroituvasti generoitu, koska

$$\mathcal{S} = \sigma\{f^{-1}((a, b] \cap f(S)) : 0 \leq a < b \leq 1, a, b \in \mathbb{Q}\} = \sigma\{A(\ell) : \ell \in \mathbb{N}\}$$

A priori tiedetään että $\forall A \in \mathcal{S}, \exists \mathcal{N}_A \subseteq \Omega$ jolla $P(\mathcal{N}_A) = 0$ ja

$$\mu_t(A; \omega) \rightarrow \mu_{\infty}(A; \omega) \quad \forall \omega \notin \mathcal{N}_A$$

Koska $P(\mathcal{N}) = 0$ jossa $\mathcal{N} = \bigcup_{\ell \in \mathbb{N}} \mathcal{N}_{A(\ell)}$, seuraa että

$$\mu_t(A_{\ell}; \omega) \rightarrow \mu_{\infty}(A_{\ell}; \omega) \quad \forall \ell \in \mathbb{N} \quad \forall \omega \notin \mathcal{N}$$

ja koska $\sigma\{A_{\ell} : \ell \in \mathbb{N}\} = \mathcal{S}$ seuraa että $\forall A \in \mathcal{S}$

$$\mu_t(A; \omega) \rightarrow \mu_{\infty}(A; \omega) \quad \forall A \in \mathcal{S} \quad \forall \omega \notin \mathcal{N} \quad (12.2.1)$$

Samoin löytyy nolla mittainen joukko $\tilde{\mathcal{N}} \subseteq \Omega$ jolla $\forall k \in \mathbb{N}, \forall \{A_i\} \subseteq \mathcal{S}$

$$\mu_t^{\circ k}(A_1 \times \cdots \times A_k; \omega) \rightarrow \mu_{\infty}^{\circ k}(A_1 \times \cdots \times A_k; \omega) \quad \forall \omega \notin \tilde{\mathcal{N}} \quad (12.2.2)$$

P -melkein varmasti äärellisulotteisten jakaumien kokoelma

$$\left\{ \mu_{\infty}^{\circ k}(dx_1, \dots, dx_k; \omega) : k \in \mathbb{N} \right\}$$

on yhteensopiva (tarkista!), ja Kolmogorovin laajennuslauseesta 2.0.1 seuraa että on olemassa satunnaismitta $\nu_{\infty}(\cdot; \omega)$ jonojen $(x_k : k \in \mathbb{N}) \subseteq S$ avaruudessa jolla $\forall k, A_1, \dots, A_k \in \mathcal{S}$

$$P(X_1 \in A_1, \dots, X_k \in A_k | \mathcal{T}_{-\infty})(\omega) = \mu_{\infty}^{\circ k}(A_1 \times \dots \times A_k; \omega) = \nu_{\infty}(\{(x_l : l \in \mathbb{N}) : x_1 \in A_1, \dots, x_k \in A_k\}; \omega)$$

Näytän että P -melkein varmasti $\nu_{\infty}(\cdot; \omega)$ on satunnaismittan kopioiden ääretön tulomitta, eli $\forall k$

$$P(X_1 \in A_1, \dots, X_k \in A_k | \mathcal{T}_{-\infty})(\omega) = \prod_{i=1}^k P(X_i \in A_i | \mathcal{T}_{-\infty})(\omega)$$

Olkoon $\mu_t^{\otimes k}$ k -kertainen tulomitta empiirisestä mitasta μ_t . Kun $f(x_1, \dots, x_k)$ rajoitettu ja Borel mitallinen,

$$\mu_t^{\otimes k}(f) = t^{-k} \sum_{1 \leq i_1, \dots, i_k \leq t} f(X_{i_1}, \dots, X_{i_k})$$

joka sisältää myös termejä joissa on toistettuja indeksejä. Silloin

$$\begin{aligned} (\mu_t^{\circ k} - \mu_t^{\otimes k})(f) &= \mu_t^{\circ k}(f) - \mu_t^{\otimes k}(f) = \\ \mu_t^{\circ k}(f) \left(1 - \frac{t!}{t^k(t-k)!} \right) &+ t^{-k} \sum_{1 \leq i_1, \dots, i_k \leq t: \exists l \neq m \ i_l = i_m} f(X_{i_1}, \dots, X_{i_k}) \end{aligned}$$

jossa ensimmäisessä osassa on termejä ilman toistettuja indeksejä ja toisessa osassa kaikissa termeissä vähintään yksi satunnaismuuttuja on toistettu. Silloin $\forall k \in \mathbb{N}, \omega \in \Omega$,

$$\begin{aligned} &|\mu_t^{\circ k}(f; \omega) - \mu_t^{\otimes k}(f; \omega)| \\ &\leq \|f\|_{\infty} \left(1 - \prod_{l=0}^{k-1} \frac{(t-l)}{t} + t^{-k} \binom{k}{2} t^{k-1} \right) \rightarrow 0 \text{ kun } t \rightarrow \infty \end{aligned}$$

jossa $\|f\|_{\infty} = \sup_{x \in S} |f(x)|$ ja arvio ei riipu ω :sta

Kaikille $A_1, A_2 \dots \in \mathcal{S}, \forall k$ P -melkein varmasti kun $t \rightarrow \infty$

$$\mu_t^{\circ k}(A_1 \times A_2 \times \dots \times A_k) \rightarrow \mu_\infty^{\circ k}(A_1 \times A_2 \times \dots \times A_k)$$

ja kun $k = 1$

$$\mu_t^{\circ 1}(A_i) \rightarrow \mu_\infty(A_i),$$

kovertenssi seuraa myös tulomitoille

$$\mu_t^{\otimes k}(A_1 \times A_2 \times \dots \times A_k) = \prod_{i=1}^k \mu_t^{\circ 1}(A_i) \rightarrow \prod_{i=1}^k \mu_\infty(A_i) = \mu_\infty^{\otimes k}(A_1 \times A_2 \times \dots \times A_k).$$

Kolmio epäyhtälöstä

$$\begin{aligned} & |\mu_\infty^{\circ k}(f) - \mu_\infty^{\otimes k}(f)| \\ & \leq |\mu_\infty^{\circ k}(f) - \mu_t^{\circ k}(f)| + |\mu_t^{\circ k}(f) - \mu_t^{\otimes k}(f)| + |\mu_t^{\otimes k}(f) - \mu_\infty^{\otimes k}(f)| \rightarrow 0 \end{aligned}$$

P -m.v. kun $t \rightarrow \infty$, ja

$$\mu_\infty^{\circ k}(f; \omega) = \mu_\infty^{\otimes k}(f; \omega) \quad P\text{-a.s}$$

kaikille rajoitetuille mitallisille $f(x_1, \dots, x_k)$. Se tarkoittaa Kolmogorovin laajennus ν_∞ on tulomitta jonojen avaruudessa $S^{\mathbb{N}}$. Rajoitetuille mitalliselle funktiolle $g_1, \dots, g_k : S \rightarrow \mathbb{R}$

$$E_P(g_1(X_1) \dots g_k(X_k) | \mathcal{T}_\infty)(\omega) = \prod_{i=1}^k \left\{ \int_S g_i(x) \mu_\infty(dx, \omega) \right\}$$

Ottaamalla odotusarvoa seuraa

$$\begin{aligned} & E_P(g_1(X_1) \dots g_k(X_k)) \\ & = E_P \left(\int_S g_i(x) \mu_\infty(dx) \right) = \int_{\mathcal{M}(S)} \left\{ \prod_{i=1}^k \int_S g_i(x) \mu(dx) \right\} Q(d\mu) \end{aligned}$$

jossa Q on satunnaismittan $\mu_\infty(dx; \omega)$ jakauman avaruudessa

$$\mathcal{M}(S) = \{ \text{todennäköisyys mittoja } \nu : S \rightarrow [0, 1] \}$$

Toisin sanoen, permutaatio-symmetrinen (eli äärettömästi vaihdettavissa) satunnaismuuttujen jono joka saa arvot Borelin avaruudessa, on riippumattomien ja samoin jakautuneiden jonojen sekoitus \square

Esimerkki 12.2.3. De Finetti todisti ensin lauseensa yksinkertaisimmassa tapauksessa, binaarijonoille, jossa $S = \{0, 1\}$. Silloin $\mathcal{M}(S) = [0, 1]$.

Olkoon $S_t(\omega) = (X_1(\omega) + \dots + X_t(\omega))$.

Jos kolikkoheittojenjono on äärettömästi vaihdettavissa P -mitan suhteen, raja-arvo $\vartheta(\omega) := \lim_{t \rightarrow \infty} t^{-1}S_t(\omega) \in [0, 1]$ on olemassa P -melkein varmasti ja $L^1(P)$:ssa

Olkoon $Q(d\theta) = P(\{\omega : \vartheta(\omega) \in d\theta\})$. Kun ehdollistetaan σ -algebraan $\sigma(\vartheta)$, kolikonheitot ovat ehdollisesti riippumattomia ja Bernoulli jakautuneita, samalla satunnais-todennäköisyysparametrilla $\vartheta(\omega) \in [0, 1]$. Raja-arvon todennäköisyysmitta $Q(d\theta)$ tulkitaan prioritodennäköisyydeksi parametrille ϑ . Silloin $\forall k$, $(x_i)_{i \in \mathbb{N}} \subseteq \{0, 1\}$,

$$P(X_1 = x_1, \dots, X_k = x_k) = \int_0^1 \left\{ \prod_{i=1}^k P(X_1 = x_i | \vartheta = \theta) \right\} Q(d\theta)$$

$$\int_0^1 \theta^{S_k} (1 - \theta)^{(k - S_k)} Q(d\theta)$$

$$Q(B) = P(\{\omega : \lim_{t \rightarrow \infty} t^{-1}S_t(\omega) \in B\}), \quad B \in \mathcal{B}([0, 1])$$

De Finettin lause on avain Bayeslaiseen päättelyyn.

Luku 13

Radon-Nikodymin lause

Määritelmä 13.0.3. Olkoon μ ja ν positiivisia mittoja todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}) , ja $\mathcal{G} \subseteq \mathcal{F}$ ali σ -algebra

ν on absoluuttisesti jatkuva μ :n suhteen ali σ -algebrassa \mathcal{G} , kun

$$A \in \mathcal{G}, \mu(A) = 0 \implies \nu(A) = 0$$

Silloin merkitään $\nu \stackrel{\mathcal{G}}{\ll} \mu$.

Kun $\mu \ll \nu$ ja $\nu \ll \mu$ mitat ovat equivalentteja, niillä on samat nolla-mittaiset joukot, ja merkitään $\mu \sim \nu$.

Lemma 13.0.1. Olkoon $Q \ll P$ todennäköisyysmittoja avaruudessa (Ω, \mathcal{F}) .

$\forall \varepsilon > 0$ on olemassa $\delta > 0$ jolla

$$A \in \mathcal{F}, P(A) < \delta \implies Q(A) < \varepsilon$$

Tod. Muuten on olemassa $\varepsilon > 0$ ja jono $(A_n : n \in \mathbb{N}) \subseteq \mathcal{F}$ jolla $P(A_n) \leq 2^{-n}$ ja $Q(A_n) \geq \varepsilon > 0$ Borel Cantelli lemmasta $P(\limsup A_n) = 0$. Käänteisestä Fatou lemmasta seuraa

$$Q(\limsup A_n) \geq \limsup Q(A_n) \geq \varepsilon > 0$$

joka on ristiriidassa oletuksen $Q \ll P$ kanssa \square

Teoreema 13.0.2. (Radon-Nikodym) Olkoon μ ja ν σ -äärellisiä positiivisia mittoja todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}) . Kun $\nu \stackrel{\mathcal{F}}{\ll} \mu$, on olemassa \mathcal{F} -mitallinen

kuvaus $Z : (\Omega, \mathcal{F}) \rightarrow (\mathbb{R}^+, \mathcal{B}(\mathbb{R}^+))$, jolla pätee mitan vaihto kaava

$$\nu(A) = \int_{\Omega} Z(\omega) \mathbf{1}_A(\omega) \mu(d\omega) \quad \forall A \in \mathcal{F}$$

Tod Koska μ ja ν are σ -äärellisiä, on olemassa numeroituva mitallinen ositus $\Omega = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} \Omega_n$ jolla $\mu(\Omega_n) < \infty$ and $\nu(\Omega_n) < \infty \forall n$. Kun otamme $P_n(d\omega) = \mu(d\omega)/\mu(\Omega_n)$ ja $Q_n(d\omega) = \nu(d\omega)/\nu(\Omega_n)$ jokaiselle Ω_n , huomaamme että lause seuraa yleisesti kun se todistetaan todennäköisyyksimitoille $Q \ll P$.

Oletamme ensin että σ -algebra \mathcal{F} on numeroituvasti viritettävissä tai separoituva, eli $\mathcal{F} = \sigma(F_n : n \in \mathbb{N})$ jossa $\{F_n\}_{n \in \mathbb{N}} \subseteq \mathbb{N}$, esimerkiksi silloin (Ω, \mathcal{F}) on Borelin avaruus.

Olkoon filtraatio $\mathbb{F} = \{\mathcal{F}_n\}$ jossa $\mathcal{F}_n = \sigma(F_1, \dots, F_n)$, ja $\mathcal{F} = \bigvee_{n \in \mathbb{N}} \mathcal{F}_n$.

Kaikille $n \in \mathbb{N}$, ottaamalla leikkauksia joukoista F_1, \dots, F_n , löytyy Ω :n \mathcal{F}_n -mitallinen ositus $\{A_1^{(n)}, \dots, A_{m_n}^{(n)}\}$ jolla $\mathcal{F}_n = \sigma(A_k^{(n)} : k = 1, \dots, m_n)$.

Määritellään \mathcal{F}_n mitallinen satunnaismuuttuja

$$Z_n(\omega) = \sum_{k=1}^{m_n} \frac{Q(A_k^{(n)})}{P(A_k^{(n)})} \mathbf{1}(\omega \in A_k^{(n)})$$

jossa $0/0$ saa mielivaltaisen arvo, esimerkiksi 0.

Koska $Q \ll P$, seuraa että $Q(A_k^{(n)}) = 0$ kun $P(A_k^{(n)}) = 0$, siksi $Z_n(\omega) \in [0, +\infty)$.

Seuraa määritelmästä että $Z_n(\omega)$ on \mathcal{F}_n -mitallinen, $Q(A_k^{(n)}) = E_P(Z_n \mathbf{1}_{A_k^{(n)}})$, $k \in \{1, \dots, m_n\}$, ja siksi $E_Q(X) = E_P(Z_n X)$ kun X on \mathcal{F}_n -mitallinen satunnaismuuttuja.

Huomataan myös että $Z_n(\omega)$ on P -integroituva (koska saa äärellisesti monta arvoa) $E_P(Z_n) = Q(\Omega) = 1$.

Näytämme että satunnaisjono $(Z_n(\omega))_{n \in \mathbb{N}}$ on $(P, \{\mathcal{F}_n\})$ -martingaali.

Olkoon $A_k^n = \bigcup_{j=1}^m A_{\ell_j}^{n+1}$ joillekin m, ℓ_1, \dots, ℓ_m .

$$E_P(Z_n \mathbf{1}_{A_k^n}) = Q(A_k^n) = \sum_{j=1}^m Q(A_{\ell_j}^{n+1}) = \sum_{j=1}^m E_P(Z_{n+1} \mathbf{1}_{A_{\ell_j}^{n+1}}) = E_P(Z_{n+1} \mathbf{1}_{A_k^n})$$

josta seuraa

$$E_P(Z_n \mathbf{1}_A) = Q(A) = E_P(Z_{n+1} \mathbf{1}_A) \quad \forall A \in \mathcal{F}_n$$

ja martingaali ominaisuus seuraa ehdollisen odotusarvon määritelmästä

$$E_P(Z_{n+1} | \mathcal{F}_n)(\omega) = Z_n(\omega).$$

Määritellän kaikille $\omega \in \Omega$

$$Z_\infty(\omega) := \limsup_{n \rightarrow \infty} Z_n(\omega).$$

Koska $(Z_n(\omega)) \geq 0$ Doobin etuperäinen martingaalikonvergenssi lauseesta seuraa että P melkein varmasti

$$Z_\infty(\omega) = \lim_{n \rightarrow \infty} Z_n(\omega)$$

jolla $Z_\infty \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$ ja $E_P(Z_\infty) \leq E_P(Z_1) = 1$.

Osoitan että $Q(A_n) = E_P(Z_\infty \mathbf{1}_{A_n}) \forall n, A_n \in \mathcal{F}_n$, ja koska nämä virittävät \mathcal{F} σ -algebran, seuraa $Q(A) = E_P(Z_\infty \mathbf{1}_A) \forall A \in \mathcal{F}$.

Koska $Q(A_n) = E_P(Z_m \mathbf{1}_{A_n})$ kun $m \geq n$, yhtälö

$$E_P(Z_\infty \mathbf{1}_{A_n}) = \lim_{m \rightarrow \infty} E_P(Z_m \mathbf{1}_{A_n}) = Q(A_n)$$

seuraa L^1 konvergenssin karakterisaatiosta kun osoitamme että P -martingaali (Z_n) on P -tasaisesti integroituva.

Koska $Q \ll P$, lemmän 13.0.1 nojalla kaikille $\varepsilon > 0$ on olemassa $\delta > 0$ jolla kun $A \in \mathcal{F}$ ja $P(A) < \delta$ seuraa $Q(A) < \varepsilon$.

Chebychevin epäyhtälöstä

$$P(Z_n > K) < K^{-1} E_P(Z_n) = K^{-1} \quad \forall n$$

Kun valitaan $K > \delta^{-1}$, koska $\{\omega : Z_n(\omega) > K\} \in \mathcal{F}_n$, mitanvaihto kaavasta

$$\sup_n E_P(Z_n \mathbf{1}(Z_n > K)) = \sup_n Q(Z_n > K) < \varepsilon$$

joka tarkoittaa tasaista integroituvuutta:

$$\lim_{K \rightarrow \infty} \sup_n E_P(Z_n \mathbf{1}(Z_n > K)) = 0$$

Siis lause on todistettu silloin kun σ -algebra \mathcal{F} on separoituva.

Yleisemmin joudumme käyttämään yleistettyjen jonojen konvergenssia.

Muistetaan määritelmä topologian kurssista:

Määritelmä 13.0.4. Topologisessa avaruudessa (E, \mathcal{T}) verkko (engl. net) on yleistetty jono $(x_\alpha : \alpha \in \mathcal{I})$ jossa indeksi joukko (I, \leq) on suunnattu, eli osittain järjestetty joukko jolla kaikille $\alpha, \beta \in \mathcal{I}$ on olemassa $(\alpha \vee \beta) \in I$ jolla

$$\alpha \vee \beta \geq \alpha, \alpha \vee \beta \geq \beta, \gamma \geq \alpha \text{ ja } \alpha \geq \beta \implies \gamma \geq \alpha \vee \beta$$

$$x_\alpha \rightarrow x \in E \text{ kun kaikille avoimille } U \ni x, \exists \bar{\alpha} \text{ jolla } x_\alpha \in U \forall \alpha \geq \bar{\alpha}.$$

(\mathbb{G}, \subseteq) on suunnattu joukko, jossa

$$\mathbb{G} := \left\{ \mathcal{G} \subseteq \mathcal{F} : \mathcal{G} \text{ on separoituva ali-}\sigma\text{-algebra} \right\}$$

Kun $\mathcal{G}', \mathcal{G}'' \in \mathbb{G}$ ovat separoituvia, myös $\mathcal{G}' \vee \mathcal{G}'' := \sigma(\mathcal{G}', \mathcal{G}'')$ on separoituva ali- σ -algebra. (\mathbb{G}, \subseteq) on verkko.

Kun \mathcal{G} on separoituva tiedämme että on olemassa satunnaismuuttuja $0 \leq Z_{\mathcal{G}}(\omega) \in L^1(\Omega, \mathcal{G}, P)$ jolla mitan vaihto kaavassa on voimassa

$$Q(A) = E_P(Z_{\mathcal{G}} \mathbf{1}_A) \quad \forall A \in \mathcal{G}$$

Osoitamme että $(Z_{\mathcal{G}} : \mathcal{G} \in \mathbb{G})$ on Cauchy-verkko $L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$:ssa, ja täydellisyydestä seuraa että on olemassa raja $Z \in L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$.

Osoitan että $\forall \varepsilon > 0$ on olemassa $\bar{\mathcal{G}} \in \mathbb{G}$ jolla kun $\mathcal{G}' \supseteq \bar{\mathcal{G}}, \mathcal{G}'' \supseteq \bar{\mathcal{G}}, \mathcal{G}', \mathcal{G}'' \in \mathbb{G}$, seuraa

$$E_P(|Z_{\mathcal{G}'} - Z_{\mathcal{G}''}|) < \varepsilon$$

Yhtäpitävästi, $\forall \varepsilon > 0 \exists \bar{\mathcal{G}}$ separoituva σ -algebra jolla kun $\bar{\mathcal{G}} \subseteq \mathcal{G}'$ separoituva, seuraa

$$E_P(|Z_{\bar{\mathcal{G}}} - Z_{\mathcal{G}'}|) < \varepsilon$$

Jos $(Z_{\mathcal{G}})$ ei olisi Cauchy verkko löytyisi $\varepsilon > 0$ ja ei-vähenevä jono $(\mathcal{G}_n : n \in \mathbb{N}) \subseteq \mathbb{G}$

$$E_P(|Z_{\mathcal{G}_n} - Z_{\mathcal{G}_{n+1}}|) \geq \varepsilon > 0$$

Olkoon $\mathcal{G}_\infty = \bigvee_{n \in \mathbb{N}} \mathcal{G}_n$, joka on myös separoituva.

Kuten todistuksen ensimmäisessä vaiheessa seuraa että

$$Z_{\mathcal{G}_n}(\omega) = E_P(Z_{\mathcal{G}_\infty} | \mathcal{G}_n)(\omega) \rightarrow Z_{\mathcal{G}_\infty}(\omega)$$

on tasaisesti integroitava martingaali joka suppenee P -melkein varmasti ja $L^1(P)$:n mielessä, joka on ristiriidassa (13) kanssa.

Täydellisessä metrisessä avaruudessa (E, d) jokainen Cauchy verkko $(x_\alpha : \alpha \in \mathcal{I})$ suppenee, eli on olemassa $x^* \in E$ jolla $\forall \varepsilon > 0 \exists \bar{\alpha}$ jolla $d(x^*, x_\alpha) \leq \varepsilon \forall \alpha \geq \bar{\alpha}$.

Todistamme myös tätä väiteettä, joka seuraa numeroituvien Cauchyn jonojen suppenemisesta.

Olkoon $\bar{\alpha}_n, n \in \mathbb{N}$ jolla $d(x_{\bar{\alpha}_n}, x_\alpha) \leq n^{-1} \forall \alpha \geq \bar{\alpha}_n$, ja valitaan $\alpha_n \geq \alpha_{n-1}$.

$\bar{x}_n := x_{\bar{\alpha}_n}$ on Cauchyn jono jolla on raja-arvo $x^* \in E$, joka on myös verkon (x_α) raja-arvo, koska kun n on tarpeeksi suuri jolla $d(x^*, x_{\bar{\alpha}_n}) < \varepsilon$ ja $n > (1/\varepsilon)$, seuraa $\forall \alpha \geq \bar{\alpha}_n$

$$d(x_\alpha, x^*) \leq d(x_\alpha, x_{\bar{\alpha}_n}) + d(x_{\bar{\alpha}_n}, x^*) < 2\varepsilon$$

Siksi yleistetyllä Cauchyn jonolla $(Z_{\mathcal{G}} : \mathcal{G} \in \mathbb{G})$ on raja-arvo $Z_\infty(\omega)$ $L^1(\Omega, \mathcal{F}, P)$:n normissa.

Seuraavaksi osoitamme että mitänvaihtokaava pätee.

Olkoon $A \in \mathcal{F}$ ja $\mathcal{G} \in \mathbb{G}$ jolla

$$E_P(|Z_\infty - Z_{\mathcal{G}'}|) < \varepsilon$$

kaikille $\mathcal{G}' \supseteq \mathcal{G}, \mathcal{G}' \in \mathbb{G}$.

Olkoon $\tilde{\mathcal{G}} := \sigma(\mathcal{G} \vee \mathcal{F}) \in \mathbb{G}$.

Koska $A \in \tilde{\mathcal{G}}$

$$Q(A) = E_P(Z_{\tilde{\mathcal{G}}} \mathbf{1}_A)$$

seuraa

$$\left| E_P(Z_\infty \mathbf{1}_A) - Q(A) \right| \leq E_P \left(|Z_\infty - Z_{\tilde{g}}| \right) < \varepsilon$$

jossa $\varepsilon > 0$ on mielivaltainen pieni \square

Luku 14

Johdatus Cramerin suurten poikkeamien teoriaan

Lause 14.0.1. (Heikko suurten lukujen laki) Olkoon $\{X_n : n \in \mathbb{N}\} \subseteq L^2(P)$ satunnaismuuttujien jono joilla $E(X_n) = 0$

$$E_P(X_n^2) \leq c < \infty \quad \forall n, \quad E_P(X_n X_m) = 0 \quad \text{kun } n \neq m$$

Merkitään $S_n(\omega) = X_1(\omega) + X_2(\omega) + \dots + X_n(\omega)$ ja otoksen keskiarvo $\bar{S}_n(\omega) = n^{-1}S_n(\omega)$.

Silloin $\bar{S}_n \rightarrow 0$ $L^2(P)$ -mielessä ja stokastisesti kun $n \uparrow \infty$.

Samoin, kun $E_P(X_n) = \mu \forall n$, seuraa $\bar{S}_n \rightarrow \mu$ $L^2(P)$ -mielessä ja stokastisesti.

Tod.

$$E_P(\bar{S}_n^2) = \frac{1}{n^2} \left\{ \sum_{i=1}^n E_P(X_i^2) + 2 \sum_{i=1}^n \sum_{1 \leq j < i} E_P(X_i X_j) \right\} = \frac{1}{n^2} \sum_{i=1}^n E_P(X_i^2) \leq \frac{c}{n}$$

Stokastinen konvergenssi seuraa L^2 -konvergenssista \square

Huomautus 14.0.1. Stokastisesta konvergenssista seuraa $P(\bar{S}_n \geq x) \rightarrow 0 \forall x > \mu$. Suurten poikkeamien teoria kertoo (tietyllä oletuksilla) että suppeneminen on eskponentiaalinen otoskoon n suhteen ja miten vauhti riippuu x :sta.

Määritelmä 14.0.5. Jono $\{a(n) : n \in \mathbb{N}\} \subseteq \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$ on subadditiivinen kun

$$a(n+m) \leq a(n) + a(m) \quad \forall n, m \in \mathbb{N}$$

182LUKU 14. JOHDATUS CRAMERIN SUURTEN POIKKEAMIEN TEORIAAN

Lemma 14.0.2. *Olkoon $\{a(n) : n \in \mathbb{N}\} \subset \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$ subadditiivinen. Silloin*

1.

$$\exists \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{a(n)}{n} = \inf_{n \in \mathbb{N}} \frac{a(n)}{n}$$

2.

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{a(n)}{n} = +\infty \iff a(n) = +\infty \quad \forall n \in \mathbb{N}$$

Tod. Olkoon $n > m \geq N$, $n = (qm + r)$ jossa $1 \leq r \leq m$, $q \in \mathbb{N}$.
Subadditiivisuudesta,

$$\begin{aligned} a(n) &\leq a(qm) + a(r) \leq qa(m) + \max_{1 \leq r \leq m} a(r) \\ \frac{a(n)}{n} &\leq \frac{q}{n}a(m) + \frac{1}{n} \max_{1 \leq r \leq m} a(r) \\ \implies \limsup_n \frac{a(n)}{n} &\leq \frac{a(m)}{m} \quad \forall m \geq N \\ \implies \limsup_n \frac{a(n)}{n} &\leq \inf_{m \geq N} \frac{a(m)}{m} \leq \liminf_m \frac{a(m)}{m} \end{aligned}$$

Tästä seuraa

$$\limsup_n \frac{a(n)}{n} = \liminf_n \frac{a(n)}{n} = \lim_n \frac{a(n)}{n}$$

Väite seuraa kun osoitamme

$$\inf_{k < N} \frac{a(k)}{k} \geq \inf_{m \geq N} \frac{a(m)}{m} \tag{14.0.1}$$

Tämä on selvä jos $a(m) = \infty \quad \forall 0 < m < N$. Muuten $a(k) < \infty$ jollekin $0 < k < N$, ja subadditiivisuudesta seuraa

$$\frac{a(kN)}{kN} \leq \frac{a(k)}{k}$$

jossa $k < N \leq kN$, Tästä seuraa (14.0.1):

$$\inf_{k < N} \frac{a(k)}{k} \geq \inf_{k < N} \frac{a(kN)}{kN} \geq \inf_{m \geq N} \frac{a(m)}{m} \quad \square$$

Teoreema 14.0.3. *Olkoon satunnaismuuttujat $\{X_n : n \in \mathbb{N}\}$ P -riippumattomia ja samoin jakautuneita. Silloin*

1. *funktio*

$$h(x) := - \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n > x) = \left(- \sup_{n \in \mathbb{N}} \frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n > x) \right) \in [0, +\infty]$$

on hyvin määritelty

2. *$h(x)$ on ei-vähenevä ja konveksi.*

3. *$h(x) < \infty \iff P(X_1 \geq x) > 0$*

$h(x)$ on jonon $(\bar{S}_n)_{n \in \mathbb{N}}$ vauhtifunktio

Tod.

1. Koska

$$\begin{aligned} P(\bar{S}_{n+m} > x) &= P(S_{n+m} > (n+m)x) \geq P(\{S_n > nx\} \cap \{S_{n+m} - S_n > mx\}) = \\ &= P(S_n > nx)P(S_m > mx) = P(\bar{S}_n > x)P(\bar{S}_m > x) \end{aligned}$$

jonon $a(n) := -\log P(\bar{S}_n > x)$ on subadditiivinen ja väite seuraa lemmasta 14.0.2.

2. Tod.

$$\begin{aligned} P\left(\bar{S}_{2n} > \frac{x+y}{2}\right) &= P(S_{2n} > n(x+y)) \geq P(\bar{S}_n > x)P(\bar{S}_n > y) \\ \iff -\frac{1}{2n} \log P(\bar{S}_{2n} > \frac{x+y}{2}) &\leq -\frac{1}{2} \left(\frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n > x) + \frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n > y) \right) \end{aligned}$$

kun $n \uparrow \infty$ seuraa

$$h\left(\frac{x+y}{2}\right) \leq \frac{1}{2} \left(h(x) + h(y) \right)$$

Tämä ominaisuus kutsutaan *keskipiste-konveksisuudeksi*. Seuraa että jatkuva kuvaus on konveksi jos ja vain jos se on keskipistekonveksi (harjoitustehtävä). Tässä osoitamme että ei-vähenevä kuvaus on konveksi jos ja vain jos se on keskipistekonveksi.

184LUKU 14. JOHDATUS CRAMERIN SUURTEN POIKKEAMIEN TEORIAAN

Osoitamme

$$h(\alpha x + (1 - \alpha)y) \leq \alpha h(x) + (1 - \alpha)h(y) \quad (14.0.2)$$

dyadisille luvuille $\alpha = k2^{-N}$, $k = 0, \dots, 2^N$, $N \in \mathbb{N}$.

Väite on jo osoitettu kun $N = 1$ $\alpha = \alpha_1 = 0, \frac{1}{2}, 1$. Oletamme induktiohypoteesia: (14.0.2) on voimassa kun $\alpha = k2^{-n}$ $k = 0, \dots, 2^n$, $1 \leq n < N$. Olkoon

$$\alpha_N := (2k + 1)2^{-N} = \frac{\alpha_{N-1}^- + \alpha_{N-1}^+}{2}$$

jossa $\alpha_{N-1}^- := k2^{-(N-1)}$, $\alpha_{N-1}^+ := (k + 1)2^{-(N-1)}$.

$$\begin{aligned} & h(x\alpha_N + y(1 - \alpha_N)) \\ &= h\left(\frac{1}{2}(x\alpha_{N-1}^- + y(1 - \alpha_{N-1}^-)) + \frac{1}{2}(x\alpha_{N-1}^+ + y(1 - \alpha_{N-1}^+))\right) \\ & \quad (\text{keskipiste-konveksisuus}) \\ &\leq \frac{1}{2}h\left(x\alpha_{N-1}^- + y(1 - \alpha_{N-1}^-)\right) + \frac{1}{2}h\left(x\alpha_{N-1}^+ + y(1 - \alpha_{N-1}^+)\right) \leq \\ & \quad (\text{induktio}) \\ &\leq \frac{1}{2}\left(\alpha_{N-1}^-h(x) + (1 - \alpha_{N-1}^-)h(y)\right) + \frac{1}{2}\left(\alpha_{N-1}^+h(x) + (1 - \alpha_{N-1}^+)h(y)\right) \\ &= \alpha_N h(x) + (1 - \alpha_N)h(y) \end{aligned}$$

eli (14.0.2) on voimassa myös kun $n = N$ ja induktiosta seuraa kaikille dyadisille luvuille α .

Olkoon $\alpha \in [0, 1]$ ja $x \geq y$, joten $h(x) \geq h(y)$. $\forall N$ on olemassa dyadinen α_N jolle $0 \leq (\alpha_N - \alpha) \leq 2^{-N}$.

$$\begin{aligned} \alpha h(x) + (1 - \alpha)h(y) &= \alpha_N h(x) + (1 - \alpha_N)h(y) + (\alpha - \alpha_N)(h(x) - h(y)) \\ &\geq h(\alpha_N x + (1 - \alpha_N)y) + (\alpha - \alpha_N)(h(x) - h(y)) \\ &\geq h(\alpha x + (1 - \alpha)y) + (\alpha - \alpha_N)(h(x) - h(y)) \end{aligned}$$

koska $\alpha_N(x - y) + y \geq \alpha(x - y) + y$, h on ei-vähenevä, ja $0 \leq (\alpha_N - \alpha) < 2^{-N}$ on mielivaltainen pieni seuraa $\forall \alpha \in [0, 1]$

$$\alpha h(x) + (1 - \alpha)h(y) \geq h(\alpha x + (1 - \alpha)y)$$

3. Koska jono $(-\log(P(\bar{S}_n > x) : n \in \mathbb{N}))$ on subadditiivinen,

$$h(x) = +\infty \iff P(\bar{S}_n > x) = 0 \iff P(X_1 > x) = 0 \quad \square$$

Määritelmä 14.0.6. $\Lambda_X(t) := \log E_P(\exp(tX_1)) = \log m_X(t)$ on momenttigeneroivafunktion logaritmi joka kutsutaan kumulanttigeneroiva funktioksi.

Määritelmä 14.0.7. Jono

$$k_n := \left. \frac{d^n}{dt^n} \Lambda_X(t) \right|_{t=0}, \quad n \in \mathbb{N}$$

kutsutaan X jakauman kumulanttien jonoksi. Kumulantit ovat kertoimet kumulanttigeneroiva funktion Taylorin kehitelmässä:

$$\Lambda_X(t) = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{k_n t^n}{n!}$$

Lemma 14.0.3. $\Lambda_X(t)$ on konvekksi.

Tod. Kun $\alpha \in [0, 1]$, eksponentit α^{-1} ja $(1 - \alpha)^{-1}$ ovat konjugatteja, Hölderin epäyhtälöstä seuraa

$$\begin{aligned} \Lambda(\alpha t + (1 - \alpha)s) &:= \log E_P(\exp(\alpha t X) \exp((1 - \alpha)s X)) \\ &\leq \log \left(E_P((\exp(\alpha t X))^{1/\alpha})^\alpha E_P((\exp((1 - \alpha)s X))^{1/(1-\alpha)})^{1-\alpha} \right) = \\ &\alpha \log E_P(\exp(tX)) + (1 - \alpha) \log E_P(\exp(sX)) \quad \square \end{aligned}$$

Olkoon $P^{(t)}$ todennäköisyysmitan P :n Esscherin muunnos (8.0.5) jonka suhteen satunnaismuuttujat X_i ovat edelleen riippumattomia ja samoin jakautuneita

$$\begin{aligned} P^{(t)}(\{X_1 \in B_1\} \cap \{X_2 \in B_2\} \cap \dots \cap \{X_n \in B_n\}) &= \\ m_X(t)^{-n} E_P(\exp(tS_n) \mathbf{1}\{X_1 \in B_1\} \mathbf{1}\{X_2 \in B_2\} \dots \mathbf{1}\{X_n \in B_n\}) &= \\ \prod_{i=1}^n E_P(\exp(tX_i - \Lambda_X(t)) \mathbf{1}\{X_i \in B_i\}) & \end{aligned}$$

jossa $B_i \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$, $n \in \mathbb{N}$.

Muistetaan että

$$\frac{d}{dt}\Lambda_X(t) = m_X(t)^{-1} \frac{d}{dt}m_X(t) = m_X(t)^{-1} E_P(X_1 \exp(tX_1)) = E_{P(t)}(X_1)$$

jossa integraalin ja derivaatan järjestyksen vaihto on sallittu olettamalla että $m_X(s) < \infty$ kun $s \in (t - \varepsilon, t + \varepsilon)$ jollekin $\varepsilon > 0$

Olkoon $x \neq \mu = E_P(X_1)$. Osoitamme että on olemassa mitanvaihtoparametri $\tilde{t} = \tilde{t}(x)$ jolla $E_{P(\tilde{t})}(X_1) = x$.

Määritelmä 14.0.8. Määritellään Legendren muunnos

$$\Lambda_X^*(x) = \sup_t \{xt - \Lambda_X(t)\}$$

Huomautus 14.0.2. Koska kuvaus $t \mapsto (xt - \Lambda_X(t))$ on derivoituva ja konkaavi, huomataan että sen maksimi saavutetaan pisteessä $\tilde{t} = \tilde{t}(x)$ jos ja vain jos

$$\frac{d\Lambda_X}{dt}(\tilde{t}) = E_{P(\tilde{t})}(X_1) = x,$$

ja $\Lambda_X^*(x) = x\tilde{t} - \Lambda_X(\tilde{t})$.

Huomautus 14.0.3. Legendren muunnos on konvekksi: kun $\alpha \in [0, 1]$,

$$\begin{aligned} \Lambda_X^*(\alpha x + (1 - \alpha)y) &= \sup_t \{ \alpha(xt - \Lambda_X(t)) + (1 - \alpha)(yt - \Lambda_X(t)) \} \leq \\ &= \alpha \sup_t \{ xt - \Lambda_X(t) \} + (1 - \alpha) \sup_s \{ ys - \Lambda_X(s) \} = \alpha \Lambda_X^*(x) + (1 - \alpha) \Lambda_X^*(y) \end{aligned}$$

Teoreema 14.0.4. (Cramerin lause) Olkoon satunnaismuuttujat $(X_n : n \in \mathbb{N})$ riippumattomia ja samoin jakautuneita, jolla $m_X(t) = E_P(\exp(tX_1)) < \infty \forall t > 0$ (josta seuraa $E_P^{(t)}(|X_1|^p) < \infty \forall p > 0, t \in \mathbb{R}$). Silloin, $\forall x \geq \mu = E_P(X_1)$,

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n \geq x) = -h(x) = -\Lambda^*(x)$$

Tod. Chebychevin epäyhtälöstä, $\forall t \in \mathbb{R}$,

$$\begin{aligned} P(\bar{S}_n \geq x) &\leq e^{-tx} E_P(\exp(t\bar{S}_n)) = \exp(-tx) m_X(t/n)^n = \exp(-tx + n\Lambda_X(t/n)) \\ &= \exp(-n(x t/n - \Lambda(t/n))) \end{aligned}$$

kun optimoidaan t :n suhteen

$$\begin{aligned} P(\bar{S}_n \geq x) &\leq \inf_{t \in \mathbb{R}} \exp(-n(tx - \Lambda(t))) \iff \frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n \geq x) \leq - \sup_{t \in \mathbb{R}} \{tx - \Lambda(t)\} \\ &= -\Lambda^*(x) \quad \forall n, x \geq \mu \end{aligned}$$

Alarajan todistus: Olkoon

$$b = \sup_{t \in \Lambda} \frac{d\Lambda}{dt} = P\text{-esssup}_\omega \{ X(\omega) \}$$

jossa $m = E_P(X) \leq b$ ja $b < \infty$ jos ja vain jos satunnaismuuttuja X on olennaisesti rajoitettu. Silloin osoitettiin jo että kun $x > b$, $P(\bar{S}_n > x) = 0$, vauhtifunktio saa arvoa $h(x) = +\infty$, ja myös

$$\Lambda^*(t) = \sup_t \{xt - \Lambda(t)\} \geq \sup_t \{(x - b)t\} = +\infty$$

Olkoon sitten $m < x < b$. Silloin on olemassa parametri arvo $\tilde{t} = \tilde{t}(x)$ jolla $\frac{d}{dt}\Lambda(\tilde{t}) = x$.

Olkoon $\tilde{P} = P^{(\tilde{t})}$ todennäköisyysmitan P :n Esscherin muunnos, parametrilla $\tilde{t} = \tilde{t}(x)$ uskottavuusosamäärällä

$$\frac{dP^{(\tilde{t})}}{dP}(\omega) = \exp(X(\omega)\tilde{t} - \Lambda(\tilde{t}))$$

jolla $E_{\tilde{P}}(X_1) = x$. Koska $\exp(tX_1(\omega)) > 0 \quad \forall t, \omega$, seuraa $P(A) = 0 \iff \tilde{P}(A) = 0 \quad \forall A \in \mathcal{F}$ ja kun X_1, \dots, X_n ovat riippumattomia ja samoin jakautuneita jakaumalla $P^{(\tilde{t})}$, uskottavuusosamäärä on

$$\frac{dP}{d\tilde{P}}(\omega) \Big|_{\sigma(X_1, \dots, X_n)} = \left(\frac{d\tilde{P}}{dP}(\omega) \Big|_{\sigma(X_1, \dots, X_n)} \right)^{-1} = \exp(-\tilde{t}S_n(\omega) + n\Lambda_X(\tilde{t}))$$

Huomataan että kumulanttigeneroiva funktio \tilde{P} mitan suhteen on

$$\tilde{\Lambda}_X(s) := \log E_{\tilde{P}}(\exp(sX_1)) = \log E_P(\exp((s + \tilde{t}))) - \Lambda_X(\tilde{t}) = \Lambda_X(\tilde{t} + s) - \Lambda_X(\tilde{t})$$

Mitan vaihto kaavalla

$$\begin{aligned} P(|\bar{S}_n - a| < \varepsilon) &= E_{\tilde{P}}(\exp(-\tilde{t}S_n(\omega) + n\Lambda_X(\tilde{t})) \mathbf{1}(|\bar{S}_n - a| < \varepsilon)) \\ &\geq \exp(n(\Lambda_X(\tilde{t}) - (a + \varepsilon)\tilde{t})) \tilde{P}(|\bar{S}_n - a| < \varepsilon) \end{aligned}$$

188LUKU 14. JOHDATUS CRAMERIN SUURTEN POIKKEAMIEN TEORIAAN

Koska oletetusti $E_P(\exp(tX)) < \infty$ myös $\tilde{t}(a)$:n ympärillä, tästä seuraa $E_{\tilde{P}}(|X|^p) < \infty \forall p > 0$, ja heikon suurten lukujen lain nojalla, $\forall \varepsilon > 0$ seuraa

$$\begin{aligned} \tilde{P}(|\bar{S}_n - a| < \varepsilon) &\rightarrow 1 \quad \text{kun} \quad n \rightarrow \infty, \\ \implies \frac{1}{n} \log P(|\bar{S}_n - a| < \varepsilon) &\geq \Lambda_X(\tilde{t}) - (a + \varepsilon)\tilde{t} + o(1/n) \end{aligned}$$

Kun $a = x + \varepsilon$, seuraa, $\forall \varepsilon > 0$

$$\frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n \geq x) \geq \frac{1}{n} \log P(x \leq \bar{S}_n \leq x + 2\varepsilon) \geq \Lambda_X(\tilde{t}) - (x + 2\varepsilon)\tilde{t} + o(1/n)$$

Tästä seuraa

$$\begin{aligned} \liminf_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n \geq x) &\geq \Lambda_X(\tilde{t}) - (x + 2\varepsilon)\tilde{t} \geq -\sup_t \{(x + 2\varepsilon)t - \Lambda_X(t)\} \\ &= -\Lambda_X^*(x + 2\varepsilon) \quad \forall \varepsilon > 0, \end{aligned}$$

ja koska $\Lambda_X^*(t)$ on konvekksi ja siksi jatkuva, siitä seuraa

$$\liminf_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n \geq x) \geq -\Lambda_X^*(x) \quad \square$$

Huomautus 14.0.4. *Katkaisemalla X satunnaismuuttujan jakaumaa voidaan luopua oletuksesta $m_X(t) < \infty \forall t \in \mathbb{R}$, oletus $X_1 \in L^1(P)$ riittää (Lause 27.3 Kallenbergin kirjasta, *Foundations of modern probability*).*

Teoreema 14.0.5. *(Dini) Olkoon $f_n : K \rightarrow \mathbb{R}$ jono jatkuvia funktioita jossa K on kompakti topologinen avaruus, esimerkiksi $K = [-T, T]$.*

Kun $f_n(x) \leq f_{n+1}(x)$, $\forall n \in \mathbb{N}, x \in K$, $f_n(x) \uparrow f(x) \in \mathbb{R}$ pistettäin. Jos raja-funktio $f : K \rightarrow \mathbb{R}$ on jatkuva, silloin konvergenssi on tasainen

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sup_{x \in K} \{f(x) - f_n(x)\} = 0$$

Tod. Koska funktio $(f - f_n)$ on jatkuva, $\forall \varepsilon > 0$

$$E_{\varepsilon, n} = \{x : (f(x) - f_n(x)) < \varepsilon\}$$

on avoin joukko, ja koska $f_n(x) \uparrow f(x) \forall x \in K$, seuraa että $\bigcup_{n \in \mathbb{N}} E_{\varepsilon, n} = K$. Koska K on kompakti, on olemassa $N(\varepsilon)$ jolla $\bigcup_{n \leq N(\varepsilon)} E_{\varepsilon, n} = K$. Koska f_n jono on monotoninen, seuraa että $\forall \varepsilon > 0, \exists N(\varepsilon)$ jolla

$$f(x) - f_n(x) \leq f(x) - f_{N(\varepsilon)}(x) < \varepsilon, \quad \forall x \in K, n \geq N(\varepsilon) \quad \square$$

Lemma 14.0.4. *Olkoon $f(t), g(t)$ jatkuvia funktioita kompaktissa K , ja*

$$f^* = \sup_{t \in K} f(t), \quad g^* = \sup_{t \in K} g(t).$$

Silloin

$$|f^* - g^*| \leq \sup_{t \in K} |f(t) - g(t)| = \|f - g\|_\infty$$

Tod. Epäyhtälö on triviaali kun $f^* = g^*$. Kun $f^* > g^*$, $\exists t^* \in K$ jolla $f^* = f(t^*) > g(t^*) > g^*$. Siitä seuraa

$$|f^* - g^*| \leq |f(t^*) - g(t^*)| \leq \|f - g\|_\infty$$

Seuraus 14.0.1. *Kun $X_1 \in L^1(P)$, Cramerin lause pätee, myös silloin kun $E_P(\exp(tX)) = \infty$ jollekin $t > 0$.*

Tod. Olkoon $x > \mu = E_P(X_1)$. Cramerin lauseen yläraja

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n > x) \leq -\Lambda^*(x)$$

seuraa joka tapauksessa Chebychevin epäyhtälöstä.

Olkoon

$$X_n^{(M)}(\omega) = (X_n(\omega) \wedge M) \uparrow X_n(\omega) \text{ kun } M \uparrow \infty,$$

$$\bar{S}_n^{(M)} = \frac{1}{n} (X_1^{(M)} + \dots + X_n^{(M)})$$

Kun $x > \mu = E_P(X_1)$

$$\frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n > x) \geq \frac{1}{n} \log P(\bar{S}_n^{(M)} > x) \rightarrow -(\Lambda^{(M)})^*(x) \quad \forall M > 0.$$

Väite on todistettu kun osoitamme että $(\Lambda^{(M)})^*(x) \downarrow \Lambda^*(x)$ kun $M \rightarrow \infty$.

Monotonisen konvergenssilauseesta seuraa $\forall t \geq 0$

$$\Lambda^{(M)}(t) = \log E_P(\exp(t(X_1 \wedge M))) \uparrow \Lambda(t) = \log E_P(\exp(tX_1)) \in \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$$

jossa $\Lambda^{(M)}(t) < +\infty \forall M, t \geq 0$, ja Dinin lauseesta seuraa että suppeneminen on tasainen kompakteissa K joissa $\Lambda(t) < \infty$.

Kun kiinnitetään $x > m$, koska $\Lambda^{(M)} \uparrow \Lambda^{(M)}$, on olemassa $K < \infty$ jolla

$$\Lambda^*(x) = \sup_t \{xt - \Lambda(t)\} = \sup_{t \in [0, K]} \{xt - \Lambda(t)\} =$$

$$(\Lambda^{(M)})^*(x) = \sup_t \{xt - \Lambda^M(t)\} = \sup_{t \in [0, K]} \{xt - \Lambda^M(t)\},$$

ja Dinin lemmasta 14.0.5 seuraa että $(\Lambda^{(M)})^*(x) \downarrow \Lambda^*(x)$ kaikissa $x > m$.

190LUKU 14. JOHDATUS CRAMERIN SUURTEN POIKKEAMIEN TEORIAAN

Luku 15

Jakaumien konvergenssi

Olkoon $(\Omega_n, \mathcal{F}_n, P_n)_{n \in \mathbb{N}}$ jono todennäköisyysavaruuksia, ja $X_n : \Omega_n \rightarrow (S, \mathcal{B}(S))$ satunnaismuuttujien jono jossa (S, ρ) on metrinen avaruus, esimerkiksi $S = \mathbb{R}^d$, Olkoon $X(\omega)$ satunnaismuuttuja todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}, P) .

Määritelmä 15.0.9. Sanotaan että jono X_n suppenee heikosti tai jakauman mielessä kohti X :n ja merkitään $X \xrightarrow{d} X$, kun

$$\forall f \in C_b(S; \mathbb{R}) = \{f : S \mapsto \mathbb{R}, \text{ jatkuva ja rajoitettu} \}, \\ E_{P_n}(f(X_n)) \rightarrow E_P(f(X)) \quad \text{kun } n \rightarrow \infty$$

Huomataan että heikko konvergenssin käsite koskee vain satunnaismuuttujien jakaumia, siksi soveltuu myös tapaukseen jossa satunnaismuuttujat eivät elä samalla todennäköisyysavaruudella. Kun $\Omega_n = \Omega$, $\mathcal{F}_n = \mathcal{F}$ ja $P_n = P \forall n$, nähdään myös että heikko konvergenssi on kaikkien heikompi konvergenssikäsite:

Lemma 15.0.5. Kun $X_n \xrightarrow{P} X$ (stokastisesti) ja f on jatkuva seuraa että $f(X_n) \xrightarrow{P} f(X)$.

Tod. Kaikille alijonolle (n_k) on olemassa alijono (n_{k_l}) jolla $X_{n_{k_l}}(\omega) \rightarrow X(\omega)$ P -melkein varmasti. Koska f on jatkuva seuraa myös että samalla alijonolla $f(X_{n_{k_l}}(\omega)) \rightarrow f(X(\omega))$. Tästä seuraa $f(X_n) \xrightarrow{P} f(X)$.

Lause 15.0.2. Kun $X_n \xrightarrow{P} X$ (stokastisesti) seuraa että $X_n \xrightarrow{w} X$ (jakauman mielessä)

Tod. Olkoon f jatkuva ja rajoitettu. Seuraa lemmasta että $f(X_n) \xrightarrow{P} f(X)$. Koska f on rajoitettu jono $\{f(X_n) : n \in \mathbb{N}\}$ on tasaisesti integroitava ja siksi $f(X_n) \xrightarrow{L^1(P)} f(X)$, josta seuraa $E_P(f(X_n)) \rightarrow E_P(f(X))$.

Osoitamme vielä lauseessa ?? että stokastinen konvergenssi seuraa jakauman konvergenssista ainoastaan kun rajajakauma on degeneroitu,

Lause 15.0.3. Olkoon $X_n : \Omega_n \rightarrow \mathbb{R}$, $X : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ satunnaismuuttujat, $F_n(t) = P_n(X_n \leq t)$, $F(t) = P(X \leq t)$. Silloin

$$X_n \xrightarrow{w} X \iff F_n(t) \rightarrow F(t) \quad \forall t : F(t-) = F(t)$$

Tod. \implies Approksimoidaan indikaattorin $x \mapsto \mathbf{1}(x \leq t)$ jatkuvalla funktiolla h_ε jossa $\varepsilon > 0$

$$h_\varepsilon(x) = \begin{cases} 1 & t \geq x \\ 1 - \frac{t-x}{\varepsilon} & t < x < t + \varepsilon \\ 0 & t + \varepsilon < x \end{cases}$$

Huomataan että

$$\mathbf{1}(x \leq t) \leq h_\varepsilon(x) \leq \mathbf{1}(x \leq t + \varepsilon)$$

josta seuraa

$$\begin{aligned} F_n(t) &\leq E_{P_n}(h_\varepsilon(X_n)) \rightarrow E_P(h_\varepsilon(X)) \leq F(t + \varepsilon) \\ \implies \limsup_n F_n(t) &\leq F(t + \varepsilon) \quad \forall \varepsilon > 0, \\ \implies \limsup_n F_n(t) &\leq F(t+) = F(t) \end{aligned}$$

koska $t \mapsto F(t)$ on oikealta jatkuva.

Samoin valitsemalla $g_\varepsilon(x) = h_\varepsilon(x + \varepsilon)$, koska

$$\mathbf{1}(x < t) \geq g_\varepsilon(x) \geq \mathbf{1}(x \leq t - \varepsilon)$$

seuraa

$$\begin{aligned} F_n(t-) &\geq E_{P_n}(g_\varepsilon(X_n)) \rightarrow E_P(g_\varepsilon(X)) \geq F(t - \varepsilon) \\ \implies \liminf_n F_n(t-) &\geq F(t - \varepsilon) \quad \forall \varepsilon > 0 \\ \implies \liminf_n F_n(t-) &\geq F(t-) \end{aligned}$$

Kun $F(t) = F(t-)$ saadaan

$$\limsup_n F_n(t) \leq F(t) = F(t-) \leq \liminf_n F_n(t-)$$

josta seuraa että $\lim_{n \rightarrow \infty} F_n(t) = F(t)$.

Toinen implikaatio seuraa Skorokhodin esityksestä.

15.0.1 Skorokhodin esitys

Olkoon $t \mapsto F(t)$ ei-vähenevä, oikealta jatkuva, $F(-\infty) = 0$, $F(+\infty) = 1$. Kanonisessa todennäköisyysavaruudessa $\Omega = [0, 1]$, joka on varustettu Borelin σ -algebralla ja tasajakaumalla P (Lebesgue mitta), voidaan rakentaa satunnaismuuttuja $X(\omega)$ jolla $P(\omega : X(\omega) \leq t) = F(t)$.

Määritellään kertymäfunktion F :n yleistetyt käänteisfunktiot

$$X^+(\omega) := \inf\{t : F(t) > \omega\} = \sup\{t : F(t) \leq \omega\}, \quad (15.0.1)$$

$$X^-(\omega) := \inf\{t : F(t) \geq \omega\} = \sup\{t : F(t) < \omega\} \quad (15.0.2)$$

- $X^+(\omega) \geq X^-(\omega)$ ovat ei väheneviä ω :n suhteen
- $\omega \mapsto X^+(\omega)$ on oikealta jatkuva ja $\omega \mapsto X^-(\omega)$ on vasemmalta jatkuva.
- Huomataan myös että $F(X^-(\omega)-) \leq \omega \leq F(X^+(\omega))$, koska F on oikealta jatkuva.

Osoitamme että $P(\omega : X^-(\omega) \leq z) = P(\omega : X^+(\omega) \leq z) = F(z)$,

ja $P(X^- = X^+) = 1$. Koska

$$X^-(\omega) \leq z \iff \omega \leq F(X^-(\omega)) \leq F(z),$$

ja P on Lebesguen todennäköisyysmitta, seuraa

$$F(z) = P([0, F(z)]) = P(\omega : \omega \leq F(z)) = P(\omega : X^-(\omega) \leq z).$$

Koska $X^+(\omega) \geq X^-(\omega) \geq X^+(\omega') \geq X^-(\omega')$ kun $\omega > \omega'$, seuraa

$$X^+(\omega) \geq X^-(\omega) \geq X^+(\omega-) := \lim_{\omega' \uparrow \omega} X^+(\omega'),$$

siksi joukko $\{\omega : X^-(\omega) < X^+(\omega)\}$ on korkeintaan numeroituva ja

$P(X^- < X^+) = 0$ (P on Lebesguen mitta). Tästä seuraa

$$P(X^+ \leq z) = P(\{X^- \leq z\} \cap \{X^+ = X^-\}) = P(X^- \leq z) = F(z)$$

Lauseen 15.0.3 implikaation \Leftarrow todistus Olkoon $z \in \mathbb{R}$ jolla $F(z-) = F(z)$, ja $F_n(z) \rightarrow F(z)$. Olkoon $X_n^+(\omega), X_n^-(\omega)$ kertymäfunktion F_n yleistetyt käänteisfunktiot kuten kaavoissa 15.0.1-2.

Koska $X^+(\omega) < z \iff \omega < F(z)$, kun n on tarpeeksi suuri $\omega < F_n(z)$ ja tämä tapahtuu jos ja vain jos $X_n^+(\omega) < z$. Silloin, $\limsup_n X_n^+(\omega) \leq z$. Tästä seuraa

$$\limsup_n X_n^+(\omega) \leq X^+(\omega)$$

muuten olisi olemassa z jolla

$$\limsup_n X_n^+(\omega) > z > X^+(\omega),$$

josta seuraa ristiriita.

Jos $X^-(\omega) > z$ seuraa $\omega > F(z)$ ja kun n on tarpeeksi suuri $\omega > F_n(z)$ josta seuraa $X_n^-(\omega) \geq z$. Silloin $\liminf_n X_n^-(\omega) \geq X^-(\omega)$.

$$X^-(\omega) \leq \liminf_n X_n^-(\omega) \leq \liminf_n X_n^+(\omega) \leq \limsup_n X_n^+(\omega) \leq X^+(\omega)$$

Joukossa $\{\omega : X^-(\omega) = X^+(\omega)\}$ jolla on todennäköisyys $P = 1$, pätee

$$\lim_n X_n^+(\omega) = \lim_n X_n^-(\omega) = X^+(\omega) = X^-(\omega)$$

Siis olemme rakentaneet satunnaismuuttujan $X(\omega) = X^\pm(\omega)$ ja satunnaismuuttujen jonon $X_n(\omega) = X_n^\pm(\omega)$ (ei ole väliä kumpaa versiota valitaan) samassa todennäköisyysavaruudessa jolla

$$X_n(\omega) \rightarrow X(\omega) \quad P\text{-melkein varmasti}, \quad P(X_n \leq t) = F_n(t), \quad P(X \leq t) = F(t)$$

Jos $f(x)$ on rajoitettu ja jatkuva testifunktio, seuraa dominoidun konvergenssin lauseesta $E_P(f(X_n)) \rightarrow E_P(f(X))$. \square

Varoitus: Olkoon $X_n, n \in \mathbb{N}$ ja $X(\omega)$ satunnaismuuttujat jotka elävät samassa todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}, P) , jolla $X_n \xrightarrow{d} X$.

Koska $P(X_n \leq t) = F_n(t) \rightarrow F(t) = P(X \leq t) \forall t$ jolla $F(t) = F(t-)$ Skorokhodin esityksellä saadaan kanonisessa todennäköisyysavaruudessa $\tilde{\Omega} = [0, 1]$ varustettuna Borelin σ -algebralla ja Lebesgue mitalla \tilde{P} ,

satunnaismuuttumien jono $\tilde{X}_n(\tilde{\omega})$ ja satunnaismuuttujan $\tilde{X}(\tilde{\omega})$ jotka elävät kanonisessa todennäköisyysavaruudessa $\tilde{\Omega} = [0, 1]$ varustettuna Borelin σ -algebralla ja Lebesgue mitalla \tilde{P} , joilla

$$\begin{aligned} \tilde{P}(\tilde{X}_n \in B) &= P(X_n \in B) \text{ ja } \tilde{P}(\tilde{X} \in B) = P(X \in B), \\ \tilde{X}_n(\tilde{\omega}) &\rightarrow \tilde{X}(\tilde{\omega}) \quad \tilde{P} \text{ m.v} \end{aligned}$$

Tämä ei kerro yhtään mitään alkuperäisestä jonon $X_n(\omega)$ P -melkein varma konvergenssista alkuperäisessä todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}, P) .

Skorokhodin esityksessä satunnaismuuttujien $(\tilde{X}(\omega), \tilde{X}_n(\omega), n \in \mathbb{N})$ yhteinen jakauma sattaa olla aivan eri kun alkuperäisten satunnaismuuttujien $(X(\omega), X_n(\omega), n \in \mathbb{N})$ yhteistä jakaumaa, vaikka yksi-ulotteiset marginaalijakaumat täsmävät. Vaikka $\tilde{X}_n(\tilde{\omega}) \rightarrow \tilde{X}(\tilde{\omega})$ \tilde{P} -melkein varmasti kanonisessa avaruudessa $\tilde{\Omega}$, siitä ei saa tehdä johtopäätöksiä alkuperäisen jonon $X_n(\omega)$ stokastisesta konvergenssista alkuperäisessä todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}, P) .

Esimerkki Todennäköisyysavaruudessa (Ω, \mathcal{F}, P) olkoon $(G_i(\omega) : i \in \mathbb{N})$ riippumattomia ja samoin jakautuneita standardi gaussisia satunnaismuuttujia, jolla $E_P(G_1) = 0, E_P(G_1^2) = 1$.

$$\text{Olkoon } \hat{S}_n(\omega) = \frac{1}{\sqrt{2^n}}(G_1(\omega) + \dots + G_{2^n}(\omega))$$

Koska $S_1 = \frac{1}{\sqrt{2}}(G_1(\omega) + G_2(\omega))$ on standardi gaussinen (harjoitustettava) seuraa induktivisesti että myös \hat{S}_n on standardi gaussinen, $P(\hat{S}_n \in B) = P(G_1 \in B)$, ja koska Gaussinen jakauma säilyy on selvää että $\hat{S}_n \xrightarrow{d} G_1$ jakauman mielessä, eikä kuitenkaan suppene stokastisesti.

Muuten voitaisiin kirjoittaa

$$\widehat{S}_{n+1} = \frac{1}{\sqrt{2}}(\widehat{S}_n + \widehat{S}'_n)$$

$$\text{jossa } \widehat{S}'_n = \frac{1}{\sqrt{2^{n-1}}}(G_{2^{n-1}+1} + \dots + G_{2^n}) \perp\!\!\!\perp \widehat{S}_n.$$

Koska jono (\widehat{S}_n) olisi stokastisesti Cauchy, Koska $\forall \varepsilon > 0, n \in \mathbb{N}$

$$\begin{aligned} P(|\widehat{S}_{n+1} - \widehat{S}_n| \geq \varepsilon) &= P(|\widehat{S}'_n - (\sqrt{2} - 1)\widehat{S}_n| \geq \sqrt{2}\varepsilon) \\ &= P(|G_1 - (\sqrt{2} - 1)G_2| \geq \sqrt{2}\varepsilon) = \eta > 0 \end{aligned}$$

jossa $\eta > 0$ ei riipu n :sta, jono $(\widehat{S}_n(\omega))$ ei voi olla stokastisesti Cauchy \square

Teoreema 15.0.6. (Lévy) Olkoon $X_n(\omega_n) \in \mathbb{R}$ satunnaismuuttujen jono todennäköisyysavaruudeilla $(\Omega_n, \mathcal{F}_n, P_n)$, $n \in \mathbb{N}$, ja $\varphi_n(\theta) = E_{P_n}(\exp(i\theta X_n))$ niiden karakteristiset funktiot.

Kun

1. On olemassa

$$\varphi(\theta) := \lim_{n \rightarrow \infty} \varphi_n(\theta) \quad \forall \theta \in \mathbb{R}.$$

2. kuvaus $\theta \mapsto \varphi(\theta)$ on jatkuva pisteessä $\theta = 0$,

siitä seuraa että $\varphi(\theta) = E_P(\exp(i\theta X))$ on jonkun satunnaismuuttujan X :n karakteristinen funktio ja $X_n \xrightarrow{d} X$ jakauman mielessä.

Tod. Osoitamme ensin että jono $(X_n : n \in \mathbb{N})$ on tiukka. Koska

$$\varphi_n(\theta) + \varphi_n(-\theta) = 2E_{P_n}(\cos(\theta X_n)) \in \mathbb{R}$$

seuraa että $(\varphi(\theta) + \varphi(-\theta)) \in [-2, 2] \subset \mathbb{R}$.

Koska $\varphi(\theta)$ on jatkuva pisteessä 0, $\forall \varepsilon > 0, \exists \delta > 0$ jolla

$$|1 - \varphi(\theta)| < \varepsilon/4 \text{ kun } |\theta| < \delta$$

Tästä seuraa

$$0 < \frac{1}{\delta} \int_0^\delta (2 - \varphi(\theta) - \varphi(-\theta)) d\theta \leq \varepsilon/2$$

Lebesguen dominoidun konvergenssin lauseesta seuraa että kun n on tarpeeksi suuri

$$0 < \frac{1}{\delta} \int_0^\delta (2 - \varphi_n(\theta) - \varphi_n(-\theta)) d\theta \leq \varepsilon$$

Kuitenkin

$$\begin{aligned} & \frac{1}{\delta} \int_{-\delta}^{\delta} \int_{\mathbb{R}} (1 - \exp(i\theta x)) F_n(dx) d\theta \\ &= \frac{1}{\delta} \int_{\mathbb{R}} \int_{-\delta}^{\delta} (1 - \exp(i\theta x)) d\theta F_n(dx) = 2 \int_{\mathbb{R}} \left(1 - \frac{\sin(\delta x)}{\delta x}\right) F_n(dx) \end{aligned}$$

jossa Fubinin lause soveltuu koska $|1 - \exp(i\theta x)| \leq 2$. Kun n on tarpeeksi suuri, saadaan

$$\varepsilon \geq 2 \int_{\mathbb{R}} \left(1 - \frac{\sin(\delta x)}{\delta x}\right) F_n(dx) \geq 2 \int_{\mathbb{R}} \left(1 - \frac{1}{\delta|x|}\right) F_n(dx) \geq P_n(|X_n| > 1/\delta)$$

eli jakaumien jono $F_n(\cdot) = P_n(X_n \leq \cdot)$ on tiukka.

Helly valinnan lauseesta ?? seuraa että on olemassa alijono F_{n_k} ja rajajakauma F jolla $F(-\infty) = 0$, $F(+\infty) = 1$ ja $F_{n_k}(t) \rightarrow F(t)$ kun $k \rightarrow \infty$ kaikissa t jossa $F(t) = F(t-)$.

Heikon konvergenssin karakterisaatiosta seuraa että

$$\varphi_{n_k}(\theta) \rightarrow \varphi_F(\theta); = \int_{\mathbb{R}} \exp(itx) F(dx) \quad \forall \theta \in \mathbb{R},$$

josta seuraa että $\varphi(\theta) = \varphi_F(\theta)$.

Osoitamme nyt että kun $F(t) = F(t-)$, koko jono $F_n(t) \rightarrow F(t)$. Se tarkoittaa että jokaisesta alijonosta n_ℓ löytyy alijonon alijono n_{ℓ_j} jolla

$$F_{n_{\ell_j}}(t) \rightarrow F(t).$$

Mutta tämä seuraa kuten ennen, koska tiukkuuden avulla löytyy alijonon alijono jolla $F_{n_{\ell_j}}$ suppenee heikosti kohti rajajakaumaa \tilde{F} , ja koska sen karakteristinen funktio pitää olla myös $\varphi(\theta)$, Lévy inversio lauseesta seuraa nähdään että myös tämä alijonon alijonon raja-jakauma on sama F \square

Teorema 15.0.7. (Lévy keskeinen raja-arvo lause) Olkoon (X_n) P -riippumattomia ja samoin jakautuneita jolla $E_P(X_1) = 0$, $\text{Var}_P(X) = \sigma^2 < \infty$

Olkoon

$$S_n(\omega) = X_1(\omega) + \dots + X_n(\omega), \quad G_n(\omega) := \frac{S_n(\omega)}{\sigma\sqrt{n}}.$$

Kun $n \rightarrow \infty$,

$$P(G_n > x) \rightarrow \Phi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x \exp\left(-\frac{x^2}{2}\right) dx = P(G \leq x)$$

Eli $G_n \xrightarrow{d} G$ jossa G on standardi Gaussinen.

Todistus.

Kun kehitetään funktion $\exp(ix)$ Taylorin sarjaksi, jäännöstermille

$$R_n(x) = e^{ix} - \sum_{k=0}^n \frac{(ix)^k}{k!}$$

pätee

$$R_0(x) = e^{ix} - 1 = i \int_0^x e^{iy} dy, \text{ josta seuraa } |R_0(x)| \leq \min\{2, |x|\}$$

ja rekursio

$$R_n(x) = \int_0^x i R_{n-1}(y) dy, \text{ josta seuraa}$$

$$\begin{aligned} |R_n(x)| &= \int_0^{|x|} \int_0^{x_1} \dots \int_{x_{n-1}} |R_0(x_n)| dx_n dx_{n-1} \dots dx_1 \leq \int_0^{|x|} \int_0^{x_1} \dots \int_0^{x_{n-1}} x_n dx_n dx_{n-1} \dots \\ &= \int_0^{|x|} \int_0^{x_1} \dots \int_0^{x_{n-1}} \int_0^{x_n} dx_{n+1} dx_n dx_{n-1} \dots dx_1 = \frac{|x|^{n+1}}{(n+1)!}, \end{aligned}$$

$$\text{ja } |R_n(x)| \leq \int_0^{|x|} \int_0^{x_1} \dots \int_0^{x_{n-1}} 2 dx_n = 2 \frac{|x|^n}{n!}$$

$$\text{eli } |R_n(x)| \leq \min\left\{\frac{2|x|^n}{n!}, \frac{|x|^{n+1}}{(n+1)!}\right\}$$

Koska $E(X) = 0$ ja $\text{Var}(X) = \sigma^2 < \infty$,

$$|\varphi_X(\theta) - 1 + \sigma^2 \theta^2 / 2| = |E_P(R_2(\theta X))| \leq E_P(|R_2(\theta X)|) \leq \theta^2 E_P\left(X^2 \wedge |\theta| \frac{|X|^3}{6}\right) < \infty$$

ja Lebesguen dominoidun konvergenssin lauseesta seuraa

$$\lim_{\theta \rightarrow 0} E_P\left(X^2 \wedge |\theta| \frac{|X|^3}{6}\right) = 0$$

siksi

$$\varphi_X(\theta) = 1 - \frac{\sigma^2\theta^2}{2} + o(\theta^2) \quad \text{kun } \theta \rightarrow 0 \quad (15.0.3)$$

Huomataan myös että kun $\log(re^{i\theta}) = \log(r) + i\theta$ kun $r > 0, \theta \in [0, 2\pi)$ on logaritmin pääarvo,

$$\log(1+z) - z = \int_0^z \frac{-w}{1+w} dw = -z^2 \int_0^1 \frac{t}{1+tz} dt,$$

ja kun $z \in \mathbb{C}, |z| < 1/2$ seuraa $|1+tz| \geq 1/2$, ja

$$|\log(1+z) - z| \leq |z|^2, \quad \text{kun } |z| \leq 1/2. \quad (15.0.4)$$

Mennään nyt keskeisen raja-arvo lauseen todistukseen: kun $\theta \in \mathbb{R}$, arviosta (15.0.3) seuraa

$$\begin{aligned} \varphi_{G_n}(\theta) &= \varphi_{S_n}\left(\frac{\theta}{\sigma\sqrt{n}}\right) = \varphi_X\left(\frac{\theta}{\sigma\sqrt{n}}\right)^n = \\ &= \left\{ 1 - \frac{\theta^2}{2n} + o\left(\frac{\theta^2}{n}\right) \right\}^n \end{aligned}$$

jossa $\theta^2/n \rightarrow 0$ kun $n \rightarrow \infty$. Arviosta (15.0.4) seuraa

$$\log \varphi_{G_n}(\theta) = n \log \left\{ 1 - \frac{\theta^2}{2n} + o\left(\frac{\theta^2}{n}\right) \right\} = n \left\{ -\frac{\theta^2}{2n} + o\left(\frac{\theta^2}{n}\right) \right\} \rightarrow -\frac{\theta^2}{2} \quad \square$$

Sovellus: Ennäysten jono Olkoon $(X_n : n \in \mathbb{N})$ P -riippumattomia ja samoin jakautuneita satunnaismuuttujia, jolla on jatkuva kertymäfunktio $F_X(t)$. Jatkuvuudesta seuraa että $P(N) = 0$ jossa

$$N := \{\omega : \exists i \neq j : X_i(\omega) = X_j(\omega)\}$$

eli tasatuloksilla on nolla todennäköisyys (harjoitusetteävä). Määritellään ennätys-tapahtumia

$$A_n := \{\omega : X_n(\omega) > X_k(\omega) \forall 1 \leq k \leq n\}$$

ja n -satunnaismuuttujan sijoitus

$$R_n := \sum_{k=1}^n \mathbf{1}(X_k \geq X_n)$$

Teoreema 15.0.8. (Rényi) Satunnaismuuttujat $(R_n : n \in \mathbb{N})$ ovat P -riippumattomia

$$P(R_n = k) = 1/n \quad k = 1, \dots, n$$

Tästä seuraa että tapahtumat $(A_n : n \in \mathbb{N})$ ovat P -riippumattomia ja $P(A_n) = P(R_n = 1) = 1/n$

Todistus Koska satunnaismuuttujat ovat P -riippumattomia ja samoin jakautuneita,

$$P(X_{\pi(1)} < X_{\pi(2)} < \dots < X_{\pi(n)}) = 1/n!$$

kaikille joukon $\{1, \dots, n\}$ permutaatioille π , eli kaikki otoksen järjestykset ovat yhtä-todennäköisiä.

Huomataan myös että jokainen realisaatio $(R_1 = 1, R_2 = r_2, \dots, R_n = r_n)$ jossa $r_k \in \{1, 2, \dots, k\}$ määrää otoksen järjestyksen, siksi

$$P(R_1 = 1, R_2 = r_2, \dots, R_n = r_n) = 1/(n!)$$

$\forall r_k \in \{1, \dots, k\}, k \leq n$. Erityisesti

$$P(\{R_n = k\}) = P(\{\pi(k) = n\}) = \frac{(n-1)!}{n!} = 1/n$$

josta seuraa

$$\prod_{k=1}^n P(\{R_k = r_k\}) = \prod_{k=1}^n \frac{1}{k} = \frac{1}{n!} = P(R_1 = 1, R_2 = r_2, \dots, R_n = r_n) \quad \square$$

Olkoon nyt

$$\mu_n(\omega) = \sum_{k=1}^n \mathbf{1}_{A_k}(\omega) = \sum_{k=1}^n \mathbf{1}(R_k = 1)$$

ennätysten määrä jonossa (X_1, \dots, X_n) .

Lause 15.0.4.

$$\frac{\mu_n(\omega)}{\log(n)} = 1 \quad P\text{-melkein varmasti}$$

Todistus Olkoon

$$M_n = \mu_n - \sum_{k=1}^n \frac{1}{k} = \sum_{k=1}^n \left\{ \mathbf{1}_{A_k}(\omega) - \frac{1}{k} \right\}$$

M_n on P -martingaali omassa filtraatiossa jolla on ennustettava kovariaatio

$$\langle M \rangle_n = \sum_{k=1}^n \frac{1}{k}$$

Luku 16

Keskeinen raja-arvo lause , Steinin todistus

Lemma 16.0.6. (Gaussinen osittaisintegrointi kaava) Olkoon $G(\omega) \sim \mathcal{N}(0, 1)$, jolla on jakauma

$$\gamma(x)dx = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \exp\left(-\frac{x^2}{2}\right)dx .$$

ja olkoon $f, h \in C^1(\mathbb{R}) \cap L^2(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}), \gamma)$ jolla myös $f', h' \in L^2(\mathbb{R}, \mathcal{B}(\mathbb{R}), \gamma)$. Silloin

$$E_P(f'(G)h(G)) = E_P\left(f(G)(h(G)G - h'(G))\right)$$

erityisesti, kun $h(x) = 1$ saadaan

$$E_P(f'(G)) = E_P(f(G)G) = \text{Cov}_P(f(G), G)$$

kun $h(x) = x$, $f \in C^2(\mathbb{R})$

$$E_P(f''(G)) = E_P(f'(G)G) = E_P(f(G)(G^2 - 1)) = \text{Cov}_P(f(G), G^2)$$

Kun $f(x) = x^m$, $h = 1$ seuraa

$$mE_P(G^{m-1}) = E_P(f'(G)) = E_P(f(G)G) = E_P(G^m G) = E_P(G^{m+1})$$

Tod.

$$f(x) = f(x_0) + \int_{x_0}^x f'(y)dy$$

Koska $\partial\gamma(x) = -x\gamma(x)$, Fubinin lauseesta

$$\begin{aligned} E_P(f'(G)) &= \int_{\mathbb{R}} f'(x)\gamma(x)dx = - \int_{\mathbb{R}} f'(x) \int_{-\infty}^x y\gamma(y)dydx \\ &= - \int_{\mathbb{R}} \left(\int_y^{\infty} f'(x)dx \right) y\gamma(y)dy = \\ &= -f(\infty) \int_{\mathbb{R}} y\gamma(y)dy + \int_{\mathbb{R}} f(y)y\gamma(y)dy = -f(\infty)E_P(G) + E_P(f(G)G) \end{aligned}$$

jossa $E_P(G) = 0$, ainakin silloin kun on olemassa $f(\infty) = \lim_{T \rightarrow \infty} f(T) \in \mathbb{R}$, ja vaikka näin ei olisi,

$$\lim_{T \rightarrow \infty} f(T) \int_{-T}^T y\gamma(y)dy = 0$$

joka tapauksessa, koska Gaussinen jakauma on symmetrinen.

Tämä pätee kun $f(x)$ on absoluuttisesti jatkuva Lebesgue mitan suhteen ja $f'(x) \in L^1(\mathbb{R}, \gamma)$ eli $\int_{\mathbb{R}} |f'(x)|\gamma(x)dx < \infty$, silloin Fubinin lauseen integroituvuuden ehto on voimassa

$$\int_{\mathbb{R}} |f'(x)|\gamma(x)dx = \int_{-\infty}^0 \int_{-\infty}^x |f'(x)y| \gamma(y)dydx + \int_0^{\infty} \int_x^{\infty} |f'(x)y| \gamma(y)dydx < \infty$$

Olkoon $(X_n(\omega) : n \in \mathbb{N})$ riippumattomien ja samoin jakautuneiden satunnaismuuttujien jono, ja $E_P(X_1) = 0$, $E_P(X_1^2) = 1$ ja $E_P(|X_1|^m) < \infty \forall m > 0$.

Merkitään $S_n(\omega) = X_1(\omega) + \dots + X_n(\omega)$. Osoitamme aluksi että, kun $f(x)$ on polynomi,

$$\lim_{n \rightarrow \infty} E_P \left(f(S_n/\sqrt{n}) \right) = E_P(f(G))$$

jossa satunnaismuuttuja $G(\omega) \sim \mathcal{N}(0, 1)$ on standardi gaussinen.

Oletamme induktio hypotheesia: kaikille $\ell = 1, \dots, m$

$$\exists L_\ell := \lim_{n \rightarrow \infty} E_P \left(\left(\frac{S_n}{\sqrt{n}} \right)^\ell \right).$$

Selvästi $L_1 = 0$ ja $L_2 = 1$.

Kun $l = (m + 1)$, symmetrisyydestä ja Newtonin kaavasta $(a + b)^m = \sum_{\ell=0}^m \binom{m}{\ell} a^\ell b^{m-\ell}$ seuraa

$$\begin{aligned} E_P(S_n^{m+1}) &= E_P \left((S_{n-1} + X_n)^m (X_1 + \dots + X_{n-1} + X_n) \right) = \\ &= n E_P \left((S_{n-1}(\omega) + X_n)^m X_n \right) \\ &= n \sum_{j=0}^m \binom{m}{j} E_P(S_{n-1}^{m-j} X_n^{j+1}) \\ &= n \sum_{j=0}^m \binom{m}{j} E_P(S_{n-1}^{m-j}) E_P(X_n^{j+1}) \\ &= nm E_P(S_{n-1}^{m-1}) + \sum_{j=2}^m \binom{m}{j} E_P(S_{n-1}^{m-j}) E_P(X_n^{j+1}) \end{aligned}$$

koska $E_P(X_n) = 0$ ja $E_P(X_n^2) = 1$. Jakamalla kertoimella $n^{(m+1)/2}$ saadaan

$$\begin{aligned} E_P \left(\left(\frac{S_n}{\sqrt{n}} \right)^{m+1} \right) &= \\ m E_P \left(\left(\frac{S_{n-1}}{\sqrt{n}} \right)^{m-1} \right) &+ \sum_{j=2}^m n^{(1-j)/2} \binom{m}{j} E_P \left(\left(\frac{S_{n-1}}{\sqrt{n}} \right)^{m-j} \right) E_P(X_n^{j+1}) \end{aligned}$$

Kun $n \rightarrow \infty$ induktio hypotheesistä seuraa

$$L_{m+1} := \lim_{n \rightarrow \infty} E_P \left(\left(\frac{S_n}{\sqrt{n}} \right)^{m+1} \right) = mL_{m-1}$$

Koska $L_1 = 0$, seuraa induktiolla $L_{2m+1} = 0 \quad \forall m$, ja koska $L_2 = 1$ seuraa

$$L_{2m} = (2m - 1)L_{2(m-1)} = (2m - 1)(2m - 3)L_{2(m-2)} = \dots = \prod_{\ell=1}^m (2\ell - 1) = \frac{(2m)!}{m!2^m}$$

Lemmasta 16.0.6 seuraa että satunnaismuuttujan $(S_n(\omega)/\sqrt{n})$ asympottiset momentit täsmävät $\mathcal{N}(0, 1)$ jakauman momenttien kanssa, riippumatta satunnaismuuttujan X_1 :n jakaumasta.

Voidaan myös laskea formaalisesti raja-jakauman momentti generoiva funktion

$$\begin{aligned} \lim_{n \rightarrow \infty} E_P \left(\exp \left(t \frac{S_n}{\sqrt{n}} \right) \right) &= \lim_{n \rightarrow \infty} E_P \left(\sum_{m=0}^{\infty} \frac{t^m}{m!} \left(\frac{S_n}{\sqrt{n}} \right)^m \right) = \\ &= \sum_{m=0}^{\infty} \frac{t^m}{m!} \lim_{n \rightarrow \infty} E_P \left(\left(\frac{S_n}{\sqrt{n}} \right)^m \right) = \sum_{m=0}^{\infty} \frac{t^m}{m!} L_m = \\ &= \sum_{m=0}^{\infty} \frac{t^{2m}}{(2m)!} L_{2m} = \sum_{m=0}^{\infty} \frac{1}{m!} \left(\frac{t^2}{2} \right)^m = \exp \left(\frac{t^2}{2} \right) = E_P(\exp(tG)) \end{aligned}$$

eli formaalisesti $n^{-1/2}S_n(\omega)$ raja-jakauman momentti generoiva funktio on standardi gaussinen.

Lemma 16.0.7. Olkoon $\{X_k(\omega) : k \in \mathbb{N}\}$ riippumattomien satunnaismuuttujien jono, jolla $E_P(X_k) = 0$ ja $E_P(X_k^2) = \sigma_k^2 < \infty$

Merkitään

$$\begin{aligned} \Sigma_n &= \sqrt{\sigma_1^2 + \dots + \sigma_n^2} \\ \hat{S}_n(\omega) &= \frac{1}{\Sigma_n} (X_1(\omega) + \dots + X_n(\omega)) \\ r_n &= \max_{1 \leq k \leq n} \frac{\sigma_k}{\Sigma_n} \\ g_n(\varepsilon) &= \frac{1}{\Sigma_n^2} \sum_{k=1}^n E_P \left(X_k^2 \mathbf{1}(|X_k| > \varepsilon \Sigma_n) \right), \quad \varepsilon > 0 \end{aligned}$$

ja $G(\omega) \sim \mathcal{N}(0, 1)$ on standardi gaussinen satunnaismuuttuja.

Olkoon $f(x) \in C^3(\mathbb{R})$ jolla on rajoitetut derivaatat:

$$\|f''\|_{\infty} := \sup_x |f''(x)| < \infty, \quad \|f'''\|_{\infty} := \sup_x |f'''(x)| < \infty,$$

1. Silloin $\forall \varepsilon > 0$,

$$\left| E_P(f(\hat{S}_n)) - E_P(f(G)) \right| \leq \left(\frac{\varepsilon}{6} + \frac{r_n}{2} \right) \|f'''\|_{\infty} + g_n(\varepsilon) \|f''\|_{\infty}$$

2. Koska $r_n^2 \leq \varepsilon^2 + g_n(\varepsilon)$, kun $\lim_{n \rightarrow \infty} g_n(\varepsilon) = 0 \forall \varepsilon > 0$, seuraa

$$\lim_{n \rightarrow \infty} E_P(f(\hat{S}_n)) = E_P(f(G))$$

Tod. Olkoon $\{\xi_k : k \in \mathbb{N}\}$ riippumattomia gaussisia satunnaismuttujat jotka ovat myös riippumattomia $(X_k : k \in \mathbb{N})$ jonosta, ja $E_P(\xi_k) = 0$ ja $E_P(\xi_k^2) = E_P(X_k^2) = \sigma_k^2$. Merkitään

$$\hat{G}_n(\omega) = \frac{1}{\Sigma_n} (\xi_1(\omega) + \cdots + \xi_n(\omega))$$

Huomataan että $\forall n \hat{G}_n(\omega)$ on standardi gaussinen.

Kiinnitämme nyt n , ja merkitään

$$\begin{aligned} \hat{X}_k(\omega) &= \frac{X_k(\omega)}{\Sigma_n}, & \hat{\xi}_k(\omega) &= \frac{\xi_k(\omega)}{\Sigma_n}, \\ \hat{U}_m(\omega) &= (\hat{X}_1(\omega) + \cdots + \hat{X}_{m-1}(\omega) + \hat{\xi}_{m+1}(\omega) + \cdots + \hat{\xi}_n(\omega)) \quad m \leq n \end{aligned}$$

Koska $f(\hat{U}_k + \hat{X}_k) = f(\hat{U}_{k+1} + \hat{\xi}_{k+1})$, teleskoppisella summalla,

$$\begin{aligned} f(\hat{S}_n) - f(\hat{G}_n) &= f(\hat{U}_n + \hat{X}_n) - f(\hat{U}_n + \hat{\xi}_n) \\ &+ f(\hat{U}_{n-1} + \hat{X}_{n-1}) - f(\hat{U}_{n-1} + \hat{\xi}_{n-1}) + \cdots + f(\hat{U}_1 + \hat{X}_1) - f(\hat{U}_1 + \hat{\xi}_1) \end{aligned}$$

Tästä seuraa

$$\left| E_P(f(\hat{S}_n)) - E_P(f(G)) \right| \leq \sum_{k=1}^m \left| E_P\left(f(\hat{U}_k + \hat{X}_k)\right) - E_P\left(f(\hat{U}_k + \hat{\xi}_k)\right) \right|$$

Olkoon

$$R_k(x) := f(\hat{U}_k(\omega) + x) - f(\hat{U}_k(\omega)) - x f'(\hat{U}_k(\omega)) - \frac{x^2}{2} f''(\hat{U}_k(\omega))$$

toisen asteen Taylorin kehittämän jäännöstermi, jossa

$$R_k(x) \leq \min\left(x^2 \|f''\|_\infty, \frac{|x|^3}{6} \|f'''\|_\infty\right)$$

Koska $\hat{X}_k \perp\!\!\!\perp \hat{U}_k$ ja $\hat{\xi}_k \perp\!\!\!\perp U_k$, $E_P(\hat{X}_k) = E_P(\hat{\xi}_k) = 0$, $E_P(\hat{X}_k^2) = E_P(\hat{\xi}_k^2) = (\sigma_k^2/\Sigma_n)$ seuraa

$$\left| E_P\left(f(\hat{U}_k + \hat{X}_k)\right) - E_P\left(f(\hat{U}_k + \hat{\xi}_k)\right) \right| \leq E_P\left(|R_k(\hat{X}_k)|\right) + E_P\left(|R_k(\hat{\xi}_k)|\right)$$

jossa

$$\sum_{k=1}^n E_P \left(|R_k(\hat{\xi}_k)| \right) \leq \frac{E_P(|G|^3)}{6} \|f'''\|_\infty \sum_{k=1}^n \left(\frac{\sigma_k^3}{\Sigma_n^3} \right) \leq \frac{r_n}{3} \sqrt{\frac{2}{\pi}} \|f'''\|_\infty$$

jossa $G \sim \mathcal{N}(0, 1)$ ja $E_P(|G|^3) = 2^{3/2}\pi^{-1/2}$, ja

$$\begin{aligned} & \sum_{k=1}^n E_P \left(|R_k(\hat{X}_k)| \right) \\ & \leq \frac{\|f'''\|_\infty}{6} \sum_{k=1}^n E_P \left(|\hat{X}_k|^3 \mathbf{1}(|\hat{X}_k| \leq \varepsilon) \right) + \|f''\|_\infty \sum_{k=1}^n E_P \left(\hat{X}_k^2 \mathbf{1}(|\hat{X}_k| > \varepsilon) \right) \\ & \leq \frac{\|f'''\|_\infty}{6} \sum_{k=1}^n E_P \left(\varepsilon \hat{X}_k^2 \mathbf{1}(|\hat{X}_k| \leq \varepsilon) \right) + \|f''\|_\infty \sum_{k=1}^n E_P \left(\hat{X}_k^2 \mathbf{1}(|\hat{X}_k| > \varepsilon) \right) \\ & \leq \varepsilon \frac{\|f'''\|_\infty}{6} + \|f''\|_\infty g_n(\varepsilon) \end{aligned}$$

Väite seuraa kun summataan yhteen näitä approksimatioita \square

Huomamme että kun satunnaismuuttujat $(X_k : k \in \mathbb{N})$ ovat riippumattomia ja samoin jakautuneita, joilla $E_P(X_1) = 0$ ja $E_P(X_1^2) = \sigma^2$, automaattisesti lemmän 16.0.7 oletus on voimassa, koska

$$g_n(\varepsilon) = \frac{1}{\sigma^2} E_P(X_1^2 \mathbf{1}(|X_1| > n\varepsilon\sigma^2)) \rightarrow 0 \text{ kun } n \rightarrow \infty.$$

Seuraavaksi yleistämme lemmän 16.0.7 siloitustekniikalla myös jatkuville funktioille joilla on korkeintaan kvadraattinen kasvu:

Teoreema 16.0.9. (Lindebergin keskeinen raja-arvo lause).

Lemman 16.0.7 asetuksissa, olkoon $f(x)$ jatkuva funktio jolle

$$|f(x)| \leq c(1 + x^2) \quad \forall x, \text{ jollekin } c > 0$$

1. Jos $g_n(\varepsilon) \rightarrow 0$ kaikille $\varepsilon > 0$ seuraa

$$E_P \left(f(\hat{S}_n) \right) \rightarrow E_P(f(G))$$

jossa $G(\omega) \sim \mathcal{N}(0, 1)$.

2. Sen lisäksi, kaikille $a < b$

$$P\left(a < \hat{S}_n \leq b\right) \rightarrow P\left(a < G \leq b\right)$$

Tod. Olkoon $Y(\omega) \in (-1, 1)$ satunnaismuuttuja jolla on sileä tiheysfunktio $\rho(y) \in C^\infty(\mathbb{R})$. Muuttujan vaihto-kaavalla seuraa että satunnaismuuttujalla $(Y(\omega)/k)$ on tiheysfunktio $k\rho(yk)$ kun $k > 0$. Määritellään

$$\begin{aligned} f_k(x) &:= E_P\left(f\left(x - Y/k\right)\mathbf{1}\left(|x - Y/k| \leq k\right)\right) \\ &= \int_{-1/k}^{1/k} f(x - y)\mathbf{1}\left(|x - y| \leq k\right)k\rho(ky)dy = \int_{-k}^k f(y)k\rho(k(x - y))dy \end{aligned}$$

$f_k(x)$ on kompaktikantainen, ja koska $f_k(x) = 0$ kun $|x| > (k + k^{-1})$, ja koska $\rho \in C^\infty(\mathbb{R})$ ja f on jatkuva, kuvaus

$$(x, y) \mapsto k^2\rho'((x - y)k)f(y)$$

on rajoitettu kompaktissa

$$C_k = \left\{ (x, y) : y \in [-k, k], x \in [y - k, y + k] \right\}$$

siksi dominoiudun konevergenssin lauseesta seuraa että f_k on derivoituva ja

$$\frac{d}{dx}f_k(x) = k^2 \int_{-k}^k f(y)\rho'((x - y)k)dy$$

Samoin seuraa korkeimpien derivaattojen olemassaolo.

Kun $k \rightarrow \infty$ dominoidun konvergenssin lauseesta seuraa

$$\lim_{k \rightarrow \infty} f_k(x) := \lim_{k \rightarrow \infty} E_P\left(f\left(x - \frac{Y}{k}\right)\mathbf{1}\left(\left|x - \frac{Y}{k}\right| \leq k\right)\right) = E_P(f(x - 0)) = f(x)$$

Osoitamme että $f_k(x) \rightarrow f(x)$ tasaisesti kompakteissa. Koska f on tasaisesti jatkuva kompakteissa, $\forall R > 0, \varepsilon > 0$ on olemassa $\delta > 0$ jolla $|f(x) - f(y)| < \varepsilon$ kun $|x| \leq R$ ja $|x - y| < \delta$. Siksi kun $k \geq \delta^{-1}$, kaikille

$$|x| \leq R$$

$$\begin{aligned} & |f(x) - f_k(x)| = \\ & = \left| f(x) - E_P(f(x - Y/k)\mathbf{1}(|x - Y/k| \leq k)) \right| \\ & = \left| E_P(f(x) - f(x - Y/k)) \right| \quad \forall x : |x| \leq R \text{ kiinteä ja } k \text{ tarpeeksi suuri} \\ & \leq E_P(|f(x) - f(x - Y/k)|) < \varepsilon \end{aligned}$$

Kolmion epäyhtälöstä, $\forall k \in \mathbb{N}$,

$$\begin{aligned} & \left| E_P\left(f(\hat{S}_n) - f(G_n)\right) \right| \\ & \leq \left| E_P\left(f(\hat{S}_n) - f_k(\hat{S}_n)\right) \right| + \left| E_P\left(f_k(\hat{S}_n) - f_k(G_n)\right) \right| + \left| E_P\left(f_k(G_n) - f(G_n)\right) \right| \end{aligned}$$

Jokaiselle $k \in \mathbb{N}$, $f_k(x)$ on sileä ja kompaktikantainen, rajoitetuilla derivaatoilla, ja täyttää 16.0.7 ehtoja

Oletuksesta $\forall \varepsilon > 0 \ g_n(\varepsilon) \rightarrow 0$ kun $n \rightarrow \infty$, seuraa $\forall k \in \mathbb{N}$

$$\left| E_P\left(f_k(\hat{S}_n) - f_k(G_n)\right) \right| \rightarrow 0 \quad \text{kun } n \uparrow \infty$$

Tasaisesta konvergenssista seuraa $\forall R > 0, \varepsilon$ on olemassa $\delta > 0$ jolle

$$|f(\hat{S}_n) - f_k(\hat{S}_n)|\mathbf{1}\left(|\hat{S}_n| \leq R\right) \leq \varepsilon$$

kun $k \geq \delta^{-1}$. Siksi $\forall n, R$.

$$\limsup_{k \rightarrow \infty} \limsup_n E_P\left(|f(\hat{S}_n) - f_k(\hat{S}_n)|\mathbf{1}\left(|\hat{S}_n| \leq R\right)\right) = 0$$

Samoin

$$\limsup_{k \rightarrow \infty} E_P\left(|f(G) - f_k(G)|\mathbf{1}\left(|G| \leq R\right)\right) = 0$$

Tästä seuraa

$$\begin{aligned} & \limsup_n \left| E_P\left(f(\hat{S}_n) - f(G)\right) \right| \leq \\ & \limsup_{k \rightarrow \infty} \limsup_n E_P\left(|f(\hat{S}_n) - f_k(\hat{S}_n)|\mathbf{1}\left(|\hat{S}_n| > R\right)\right) \\ & + \limsup_{k \rightarrow \infty} E_P\left(|f(G) - f_k(G)|\mathbf{1}\left(|G| > R\right)\right) \end{aligned}$$

Nyt käytämme hypotheesia $|f(x)| \leq c(1+x^2)$. Kun $|x| \geq 2$ seuraa

$$|f_k(x)| \leq E_P(|f(x - Y/k)|) \leq c(1+(|x|+1)^2) \leq 2c(1+x^2) \text{ ja}$$

$$|f_k(x) - f(x)| \leq |f_k(x)| + |f(x)| \leq 3c(1+x^2), \text{ siksi}$$

$$\begin{aligned} & \limsup_n \left| E_P \left(f(\hat{S}_n) - f(G) \right) \right| \\ & \leq \limsup_n 3c E_P \left((1 + \hat{S}_n^2) \mathbf{1}(|\hat{S}_n| > R) \right) + c E_P \left((1 + G^2) \mathbf{1}(|G| > R) \right) \end{aligned}$$

Koska $G \in L^2(P)$,

$$\lim_{R \rightarrow \infty} E_P \left((1 + G^2) \mathbf{1}(|G| > R) \right) = 0.$$

Seuraavaksi approksimoidaan indikaattori $\mathbf{1}(|x| > R)$ sileällä funktiolla.

Olkoon $\eta \in C^\infty : \mathbb{R} \rightarrow [0, 1]$, jolla

$$\eta(x) = \begin{cases} 1 & \text{kun } |x| \geq 1 \\ 0 & \text{kun } |x| \leq 1/2 \\ \in (0, 1) & 1/2 < |x| < 1 \end{cases}$$

$$\psi_R(x) := (1+x^2)\eta(x/R) \leq (1+x^2) \quad \text{jolla}$$

$$(1+x^2)\mathbf{1}(|x| > R) \leq \psi_R(x) \leq (1+x^2)\mathbf{1}(|x| > R/2).$$

Koska

$$\frac{d^2}{dx^2} \psi_R(x) = R^{-2} \eta''(x/R)(1+x^2) + R^{-1} \eta'(x/R)2x + 2\eta(x/R)$$

ja derivaatat $\eta^{(\ell)}(x/R) = 0$, $\ell \geq 1$, ovat kompaktikantaisia seuraa

$$\sup_x |\psi_R''(x)| < \infty, \quad \sup_x |\psi_R'''(x)| < \infty.$$

Lemmasta 16.0.7 seuraa

$$\left| E_P(\psi_R(\hat{S}_n)) - E_P(\psi_R(G)) \right| \rightarrow 0$$

kun $n \rightarrow \infty$, ja

$$\begin{aligned} & E_P \left((1 + S_n^2) \mathbf{1}(|\hat{S}_n| > R) \right) \\ & \leq E_P(\psi_R(\hat{S}_n)) \rightarrow E_P(\psi_R(G)) \leq E_P \left((1 + G^2) \mathbf{1}(|G| > R/2) \right) \rightarrow 0 \text{ kun } R \uparrow \infty. \end{aligned}$$

Lopuksi olkoon $a < b$. On olemassa jatkuvien funktioiden jonoja $(\bar{\psi}_m)$, $(\underline{\psi}_m) \subseteq C^\infty(\mathbb{R})$ joilla

$$0 \leq \underline{\psi}_m(x) \uparrow \mathbf{1}_{(a,b]}(x), \quad 1 \geq \bar{\psi}_m(x) \downarrow \mathbf{1}_{(a,b]}(x)$$

Väitteestä (1) ja monotonisesta konvergenssista seuraa

$$\begin{aligned} \liminf_n P(a < \hat{S}_n \leq b) &\geq \liminf_n E_P(\bar{\psi}_m(S_n)) = E_P(\bar{\psi}_m(G)) \downarrow P(a < G \leq b) \\ \limsup_n P(a < \hat{S}_n \leq b) &\leq \limsup_n E_P(\underline{\psi}_m(S_n)) = E_P(\underline{\psi}_m(G)) \uparrow P(a < G \leq b) \end{aligned}$$

kun $m \rightarrow \infty$ \square

Teoreema 16.0.10. Yleistetty keskeinen raja-arvo lause Olkoon $(X_n(\omega) : n \in \mathbb{N})$ jono P -riippumattomia ja samoin jakautuneita satunnaismuuttujia, joiden tiheysfunktio $p(x)$ on olemassa ja totetuttaa

1. $p(x) = p(-x)$, $x \in \mathbb{R}$
2. $\lim_{x \rightarrow \infty} p(x)x^{\alpha+1} = c \in (0, +\infty)$, jossa $0 < \alpha < 2$,

Silloin

$$\hat{S}_n = \frac{X_1 + \cdots + X_n}{n^{1/\alpha}} \xrightarrow{d} \hat{Y}$$

jossa Y :n jakaumalla on karakteristinen funktio $\varphi_Y(t) = \exp(-c|t|^\alpha)$.

Tod. Osoitamme ensin että

$$\lim_{t \rightarrow 0} \varphi_X(t) = 1 - c|t|^\alpha + o(|t|^\alpha) \quad \text{kun } t \rightarrow 0$$

Tästä seuraa

$$\varphi_{\hat{S}_n}(t) = \left(\varphi_X(tn^{-1/\alpha}) \right)^n = \left(1 - \frac{c|t|^\alpha + o(1)}{n} \right)^n \rightarrow \exp(-c|t|^\alpha) \quad \text{kun } n \rightarrow \infty$$

Lähdetään nyt arvioimaan $\varphi_X(t)$ kun $t \rightarrow 0$. Käytämme symmetriaa $p(x) = p(-x)$, josta seuraa $\varphi_X(t) = \varphi_X(-t) = \overline{\varphi_X(t)} \in \mathbb{R}$. Kun $M > 0$ kiinteä,

$$\varphi_X(t) = \int_{\mathbb{R}} p(x)e^{itx} dx = \int_{-\infty}^{\infty} \cos(tx)p(x) dx = 1 - \int_{\mathbb{R}} (1 - \cos(tx))p(x) dx$$

olkoon $t > 0$

$$\int_0^\infty (1 - \cos(tx)) dx = \int_0^{1/t} (1 - \cos(tx)) p(x) dx + \int_{1/t}^\infty (1 - \cos(tx)) p(x) dx \leq t \int_0^{1/t} xp(x) dx$$

$$\int_0^M p(x) \cos(tx) dx + \int_M^{1/t} p(x) \cos(tx) dx + \int_{1/t}^{+\infty} p(x) \cos(tx) dx$$

jossa kun $t \downarrow 0$

$$\left| \int_{1/t}^{+\infty} p(x) \cos(tx) dx \right| \leq \text{Const.} t^\alpha \downarrow 0$$

Koska $1 - \cos(x) \leq x^2/2$,

$$\left| \int_0^M p(x) (\cos(tx) - 1) dx \right| \leq \frac{ct^2}{2} \int_0^M p(x) x^2 dx \leq \frac{cM^2 t^2}{2} \rightarrow 0 \text{ kun } t \rightarrow 0$$

$$\text{ja } \left| e^{itx} - 1 \right| \leq |tx|$$

$$\left| \int_M^{1/t} p(x) \left(e^{itx} - 1 - itx \right) dx \right| \leq \frac{ct^2}{2} \int_M^{1/t} x^{1-\alpha} dx \leq \text{Const.} t^\alpha \rightarrow 0 \text{ kun } t \rightarrow 0$$

Siis

$$\varphi_X(t) = \int_0^{1/t} p(x) dx + \int_M^{1/t} itx$$

Luku 17

Suurten satunnaismatriisien ominaisarvojen jakauma

Olkoon $\{\xi_{ij}(\omega) : i \in \mathbb{N}, 1 \leq j \leq i\}$ P -riippumattomia ja samoinjakautuneita satunnaismuuttujia jolla pätee

1. $E(|\xi_{ij}|^k) < \infty \quad \forall k \in \mathbb{N}$.
2. $E(\xi_{ij}) = 0, E(\xi_{ij}^2) = 1$
3. ξ_{ij} jakauma on symmetrinen, eli $P(\xi_{ij} \in B) = P(-\xi_{ij} \in B)$.

Jakauman symmetriasta seuraa että $E_P(\xi_{ij}^{2k+1}) = 0 \quad \forall k \in \mathbb{N}$. Merkitään myös $\xi_{ij}(\omega) = \xi_{ji}(\omega)$ kun $j > i$.

Olkoon $A^{(n)}(\omega) \in \mathbb{R}^{n \times n}$ symmetrinen satunnaismatriisi jolla $A_{ij}^{(n)}(\omega) = A_{ji}^{(n)}(\omega) = \frac{\xi_{ij}(\omega)}{2\sqrt{n}}$, ja olkoon $\lambda_1^{(n)} \leq \lambda_2^{(n)} \leq \dots \leq \lambda_n^{(n)}$ sen ominaisarvot.

Ominaisarvojen jakauma on

$$Q^{(n)}(B) = E_P \left(\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \mathbf{1}(\lambda_i^{(n)} \in B) \right), \quad B \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$$

Osoitamme että $Q^{(n)}$ suppenee jakauman mielessä kohti satunnaismuuttujan jakaumaa.

Tutkimme $Q^{(n)}$ momentteja

$$M^{n,k} := \int_{\mathbb{R}} \lambda^k Q^{(n)}(d\lambda) = E_P \left(\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (\lambda_i^{(n)})^k \right) =$$

$$E_P \left(\frac{1}{n} \text{Trace}((A^{(n)})^k) \right) = \frac{1}{2^k n^{1+k/2}} \sum_{i_1=1}^n \sum_{i_2=1}^n \cdots \sum_{i_k=1}^n E_P \left(\xi_{i_1 i_2} \xi_{i_2 i_3} \cdots \xi_{i_k i_1} \right)$$

P -riippumattomuudesta ja jakauman symmetriasta huomataan että odotusarvo on nolla silloin kun satunnaismuuttuja $\xi_{j\ell}$ esiintyy paritonta monta kertaa. Erityisesti $M^{n,k} = 0$ kun k on pariton. Oletetaan sitten että $k = 2m$ on parillinen.

Todistamme että kun $n \rightarrow \infty$, rajaarvoon kontribuovat pelkästään termejä jossa jokainen indeksi pari $\{j, \ell\}$ esiintyy täsmälleen 0 tai 2 kertaa.

Jokainen termi summassa vastaa suljettua polkua $i_1 i_2 i_3 \dots i_{2m} i_1$ joka kulkee joukossa $\{1, \dots, n\}$ ja palaa takaisin alkutilaan. Sanotaan että polku kulkee parin $\{j, \ell\}$ kautta jos $i_s = j, i_{s+1} = \ell$ tai $i_s = \ell, i_{s+1} = j$ jollekin $s = 1, \dots, 2m$. Myös $\{j, j\}$ on mahdollinen pari.

Polun kontribuutio on 0 jos jokin pari esiintyy polussa paritonta monta kertaa. Että polun kontribuutio summalle olisi positiivinen, jokain pari $\{j, \ell\}$ pitää esiintyä parillista monta kertaa.

Sanotaan että $\pi = (\pi_1, \dots, \pi_m) \in \mathbb{N}^m$ on m -osituksen jos

$$1\pi_1 + 2\pi_2 + \cdots + m\pi_m = m$$

Merkitään $|\pi| = \pi_1 + \pi_2 + \cdots + \pi_m$.

$$\sum_{i_1=1}^n \sum_{i_2=1}^n \cdots \sum_{i_{2m}=1}^n E_P \left(\xi_{i_1 i_2} \xi_{i_2 i_3} \cdots \xi_{i_k i_1} \right) = \sum_{\pi} N_{\pi} C_{\pi}$$

jossa π on $(2m)$ -ositus,

$$C_{\pi} = \prod_{\ell=1}^m E_P(\xi_{11}^{2\ell})^{\pi_{\ell}}$$

$$N_{\pi} =$$

Olkoon $X^{(n)}(\omega) \in \mathbb{R}^{n \times n}$ satunnaismatriisi jolla $X_{ij}^{(n)}(\omega)$ ovat satunnaisia.