

L^1 空間における最良近似と統計への応用

大阪市大 理学部 工藤弘吉

1. 確率変数 X のメジアン $\mu(X)$ は X の平均偏差 (または平均絶対誤差) $E[|X-a|]$ を最小にするような a の値であることは周知の事実である (例えば Cramer [3, p. 178]). 一方条件付メジアンの定義も例えば Loève [11, p. 385] などにも厳密に与えられているのであるから, それが条件付平均偏差を最小にするものであることは当り前のことと了解されている. ところが函数解析の立場からは, L^1 空間での部分空間における最良近似が必ずしも存在しないという事柄からいって, 上のことは自明だとは云えないということである. そこでこの事に関して新谷・安藤論文 [16] の結果を中心にして第 2 節で述べてみたい.

筆者がこのような問題に関係するようになったのは, 部分 σ 代数の収束の問題, 特に下の [C-1] と [B-2] との同等性の証明に関してである. 部分 σ 代数の収束についてはかなり多様な

定義が可能であって、それらの定義の関係は複雑であり、この収束については第3節で述べる。

最後の節では部分 σ 代数の収束の問題の発端となった漸近十分統計量の問題について報告する。最近の数理統計学では統計量と部分 σ 代数とはほとんど同義語として取扱っても差支ない。特に統計量の十分性の問題は統計量の関数としての性格よりは部分 σ 代数としての性格に関するものであって、その収束を論ずる場合はどうしても部分 σ 代数の収束の意味を考へざるを得ないことになる。漸近十分統計量の概念は筆者が導入したものであるが、それが部分 σ 代数の収束の概念を通じて左来の十分性と密接な関係にあることがわが、てきた。

2. 最良近似 確率空間 (Ω, \mathcal{A}, P) は、集合 Ω 、その部分集合の σ 代数 \mathcal{A} および \mathcal{A} 上で定義された確率測度 P からなりたつ。以下 \mathcal{A} の部分 σ 代数 \mathcal{B} はすべて (\mathcal{A}, P) 完備 ($A \in \mathcal{A}$, $B \in \mathcal{B}$ かつ $P(A \triangle B) = 0$ なら $A \in \mathcal{B}$ となること) であるとする。 P の部分 σ 代数 \mathcal{B} への制限もまた同じ記号 P であらわすことにする。そのとき (Ω, \mathcal{B}, P) もまた一つの確率空間であり、そこで^(P による)可積分な実数値函数の全体を $L^p(\mathcal{B})$ であらわそう。そうすると、 $L^1(\mathcal{B})$ は $L^1(\mathcal{A})$ の部分空間である。

$f (\in L^1(\mathcal{A}))$ の平均を $E[f] = \int f \, dP$ (P を明示する必要があるときは $E_P[f]$) であらわす。 $f (\in L^1(\mathcal{A}))$ の

$\mathcal{B} (\subset \mathcal{A})$ が与えられた条件付平均 $E^{\mathcal{B}}[f]$ (または $E_P^{\mathcal{B}}[f]$) は, $\forall B \in \mathcal{B} : E[f \cdot 1_B] = E[1_B \cdot g]$ をみたす $g \in L^1(\mathcal{B})$ をあらわす. $A \in \mathcal{A}$ の \mathcal{B} が与えられた条件付確率 $P^{\mathcal{B}}(A)$ は $E^{\mathcal{B}}[1_A]$ のことである. $f \in L^1(\mathcal{A})$ の \mathcal{B} が与えられた条件付メジアン は $P^{\mathcal{B}}\{f < g\} \leq \frac{1}{2} \leq P^{\mathcal{B}}\{f \leq g\}$ なる $g \in L^1(\mathcal{B})$ である. どんな $f \in L^1(\mathcal{A})$ に対しても, その \mathcal{B} が与えられた条件付メジアンは存在するが一意的とは限らない. ただし条件付メジアンには最大のもの $M^{\mathcal{B}}[f]$, 最小のもの $m^{\mathcal{B}}[f]$ が存在して, $m^{\mathcal{B}}[f] \leq g \leq M^{\mathcal{B}}[f]$ なる $g \in L^1(\mathcal{B})$ はすべて \mathcal{B} の与えられた条件付メジアンである. $f \in L^1(\mathcal{A})$, $\mathcal{B} (\subset \mathcal{A})$ が与えられたとき, $L^1(\mathcal{A})$ のノルムの意味で f に最も近い $g \in L^1(\mathcal{B})$ を f の \mathcal{B} 可測最良近似 という. どんな $f \in L^1(\mathcal{A})$ に対しても \mathcal{B} 可測最良近似と \mathcal{B} が与えられた条件付メジアンとは完全に一致する. ([16, 定理 2], [9, Appendix 定理 A.1]).

$f \in L^1(\mathcal{A})$ からその \mathcal{B} 可測最良近似までの距離は f から $L^1(\mathcal{B})$ までの最短距離 $e_P(f, \mathcal{B})$ (P が前後の脈絡から明らかなきときは P を略して $e(f, \mathcal{B})$ とかく, 第 3 節までは P を略す) であるが, それは

$$(2.1) \quad e(f, \mathcal{B}) = \int_{-\infty}^{\infty} \left\{ \frac{1}{2} - \int \left| \frac{1}{2} - P^{\mathcal{B}}\{f \leq t\} \right| dP \right\} dt$$

で表わされる. 特に $f \equiv 1_A$ ($A \in \mathcal{A}$) のときは, それは

$$(2.2) \quad d(A, B) = \min P(A \Delta B) = \frac{1}{2} - \int \left| \frac{1}{2} - P^B(A) \right| dP$$

と一致する。([16, 系4], [8; Remark 2.1]). この量は距離 $P(A \Delta B)$ によつて A を距離空間とみなしたとき, A から閉集合 B までの最短距離である. ここで Δ は集合の対称差を表わす.

$\{g_n\}$ ($g_n \in L^1(B)$) が $\lim_{n \rightarrow \infty} \|g_n - f\|_1 = e(f, B)$ をみたすとき, $\{g_n\}$ は相対弱コンパクトであつて, その弱極限は f の B 可測最良近似である ([16, 定理5])

この定理から直ちに, 上記の $\{g_n\}$ は $\|g_n \vee M^B[f] - M^B[f]\|_1 \rightarrow 0$, $\|g_n \wedge m^B[f] - m^B[f]\|_1 \rightarrow 0$ ($n \rightarrow \infty$) をみたす ([16, 系6]).

なお条件付メジアン の性質については Tomkins [17] をみよ.

3. σ 代数の収束 $\{\mathcal{B}_n\}$ を \mathcal{A} の部分 σ 代数 \mathcal{B}_n の列とする. まずはじめに $\{\mathcal{B}_n\}$ の収束の定義を筆者の知る限り列挙すれば次の通りである.

[A] 集合論的定義: \cap は集合論的な共通部分, \vee は "... を含む最小の σ 代数" をあらわす記号とする.

$$(1) \quad (s)\text{-}\overline{\lim} \mathcal{B}_n = \bigcap_{m=1}^{\infty} \bigvee_{n=m}^{\infty} \mathcal{B}_n, \quad (s)\text{-}\underline{\lim} \mathcal{B}_n = \bigvee_{m=1}^{\infty} \bigcap_{n=m}^{\infty} \mathcal{B}_n$$

として, $(s)\text{-}\overline{\lim} \mathcal{B}_n = (s)\text{-}\underline{\lim} \mathcal{B}_n (= \mathcal{B}_0 \text{ とおく})$ のとき

$$\mathcal{B}_0 = (s)\text{-}\lim \mathcal{B}_n \text{ とする.}$$

もちろん $\{\mathcal{B}_n\}$ が単調なら ($\mathcal{B}_n \subset \mathcal{B}_{n+1}$ または $\mathcal{B}_{n+1} \subset \mathcal{B}_n$ なら)

$(s)\text{-}\lim_{n \rightarrow \infty} \mathcal{B}_n$ は存在する. この収束は確率測度に関係ない. なお

Nguyen [14] は上の収束より弱いものを定義しているが、これも確率測度 P に関係ないので、われわれの目的にあまり影響がないから省略する。

[B] 幾何学的定義 距離 $P(A \triangle B)$ によって σ 代数 \mathcal{A} を距離空間とみなすとき、 \mathcal{A} の部分 σ 代数は \mathcal{A} の開部分集合であり、 $d(A, B)$ は A から B までの距離である。

(1) Boylan [2] の同程度収束。2つの部分 σ 代数 $\mathcal{B}, \mathcal{B}'$ に対して $D(\mathcal{B}, \mathcal{B}') = \sup_{B \in \mathcal{B}'} d(B, \mathcal{B}) + \sup_{B \in \mathcal{B}} d(B, \mathcal{B}')$ とおくと、部分 σ 代数全体 \mathcal{B} は D を距離とする距離空間となる。この距離空間は完備である。距離 D による収束を B 収束ということにする。

Rogge [15] は上の D を少し修正したが、収束に関する限りでは特記する必要はない。

(2) $\forall A (\in \mathcal{A}): d(A, \mathcal{B}_n) \rightarrow d(A, \mathcal{B}_0)$ のとき、 $\{\mathcal{B}_n\}$ が \mathcal{B}_0 に d 弱収束するという。

(3) 岩田弱収束: $(i)\text{-}\underline{\lim} \mathcal{B}_n = \{A (\in \mathcal{A}): \lim_{n \rightarrow \infty} d(A, \mathcal{B}_n) = 0\}$, $(i)\text{-}\overline{\lim} \mathcal{B}_n = \bigvee \{A (\in \mathcal{A}): \underline{\lim}_{n \rightarrow \infty} d(A, \mathcal{B}_n) = 0\}$ とおき、 $(i)\text{-}\underline{\lim} \mathcal{B}_n = (i)\text{-}\overline{\lim} \mathcal{B}_n (= \mathcal{B}_0)$ のとき、 \mathcal{B}_n は \mathcal{B}_0 に岩田弱収束という (岩田 [5])。

ここで $(i)\text{-}\underline{\lim} \mathcal{B}_n$ は σ 代数であることは容易に示される。

[C] 函数解析的定義 $L^p(\mathcal{A})$ の内部分空間の列 $\{L^p(\mathcal{B}_n)\}$

の収束によって $\{\mathcal{B}_n\}$ の収束を定義する。

(1) $\forall f (\in L^p(\mathcal{A})) : e(f, \mathcal{B}_n) \rightarrow e(f, \mathcal{B}_0)$ であるとき、 \mathcal{B}_n は \mathcal{B}_0 に e 弱収束するという。

(2) Becker 弱収束. σ 代数 $\mathcal{B}, \mathcal{B}', g (\in L^\infty(\mathcal{A}))$ に対して, $D(\mathcal{B}, \mathcal{B}' | g) = \sup_{f \in L^1(\mathcal{B})} \inf_{f' \in L^1(\mathcal{B}')} |\int (f-f')g dP| + \sup_{f' \in L^1(\mathcal{B}')} \inf_{f \in L^1(\mathcal{B})} |\int (f-f')g dP|$ とおき, $\forall g (\in L^\infty(\mathcal{A})) : D(\mathcal{B}_n, \mathcal{B}_0 | g) \rightarrow 0$ となるとき \mathcal{B}_n は \mathcal{B}_0 に Becker 弱収束という (Becker [1]). この D は一様構造を与えるがそれは完備である. なお上記の収束は Becker の与えた位相をやや変形して収束の形で述べたものである.

[D] 条件付平均の収束による定義 確率変数の収束の種類に伴って多くの種類の収束が定義できる.

(1) \mathcal{B}_n が \mathcal{B}_0 に a.e. 収束するとは, $\forall f (\in L^p(\mathcal{A})) : E^{\mathcal{B}_n}[f] \rightarrow E^{\mathcal{B}_0}[f], a.e.$ マルチンゲールの理論によると, $\{\mathcal{B}_n\}$ が単調列であれば, この収束は集合論的収束 [A-1] に一致する.

(2) \mathcal{B}_n が \mathcal{B}_0 に確率収束するとは, $\forall f (\in L^p(\mathcal{A})) : E^{\mathcal{B}_n}[f] \rightarrow E^{\mathcal{B}_0}[f] \text{ in prob.}$

(3) \mathcal{B}_n が \mathcal{B}_0 に強収束 (または L^p 収束) するとは, $\forall f (\in L^p(\mathcal{A})) : \|E^{\mathcal{B}_n}[f] - E^{\mathcal{B}_0}[f]\|_p \rightarrow 0$, ただし $1 \leq p \leq \infty$ とする.

(4) \mathcal{B}_n が \mathcal{B}_0 に弱収束するとは, $\forall f (\in L^p(\mathcal{A})), \forall g (\in L^q(\mathcal{A})) : \int E^{\mathcal{B}_n}[f]g dP \rightarrow \int E^{\mathcal{B}_0}[f]g dP$, ただし $p \in [1, \infty), \frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$.

(2), (3)は Neveu [12; p.124] に載っているものであり、この意味の収束では B は完備空間である。(4)は Becker [1] で僅かにふれられているにすぎない収束概念であるが、もちろん Becker 弱収束とは異なる概念であり、ここでの収束の意味では B は完備ではないことに注意されたい。

条件付平均を用いることによつてさらにもう1つの収束を定義できる。一般的には確率変数列のノルムが収束するからといって、その極限が定まるということはないのであるが、条件付平均の列の場合には、そのノルムが収束するとき、部分 σ 代数列の極限が定まるのである。それは条件付平均のノルムが σ 代数の大きさに依存するという事実に基くのである。

(5) “ $\forall f (\in L^p(\mathcal{A})) : \overline{\lim}_{n \rightarrow \infty} \|E^{\beta_n}[f]\|_p \leq \|E^\beta[f]\|_p$ ($\underline{\lim}_{n \rightarrow \infty} \|E^{\beta_n}[f]\|_p \geq \|E^\beta[f]\|_p$)” をみたす σ 代数 β の中で最小(最大)のものが存在する。この最小(最大)のものを $(p)\text{-}\overline{\lim} \beta_n$ ($(p)\text{-}\underline{\lim} \beta_n$) とおく。 $(p)\text{-}\underline{\lim} \beta_n = (p)\text{-}\overline{\lim} \beta_n$ がなりたつとき、 $\beta_0 = (p)\text{-}\underline{\lim} \beta_n$ と定義する。($p=1$ については Kudō [8], $p>1$ については安藤氏よりの私信)。なお岩田[5]によれば、 $(s)\text{-}\underline{\lim} \beta_n \leq (i)\text{-}\underline{\lim} \beta_n = (p)\text{-}\underline{\lim} \beta_n \leq (p)\text{-}\overline{\lim} \beta_n \leq (i)\text{-}\overline{\lim} \beta_n \leq (s)\text{-}\overline{\lim} \beta_n$ ということである。さらに、 $p>1$ のときは、条件付平均 E^β の代りに最良近似 (=条件付メジアン, 予測) μ^β を用いることができる。

$\forall f(\in L^1(\mathcal{A})): \exists g(\in L^1(\mathcal{B})): \forall P(\in \mathcal{P}), \forall B(\in \mathcal{B}): \int_B f dP = \int_B g dP$ であるとき — \mathcal{B} は \mathcal{P} に対して十分であるという。ある確率測度 λ に関して \mathcal{P} のどの要素も絶対連続であるとき、 λ を \mathcal{P} の *dominate* 測度という。 *dominate* 測度をもつ \mathcal{P} を *dominated* であるという。 \mathcal{A} が σ -generated ならば、 \mathcal{P} が *dominated* であるためには \mathcal{P} に距離 $\|P - P'\|_{\mathcal{A}}$ で位相を入れたときそれが可分となることが必要十分である、ここで signed 測度 $P - P'$ につけられた $\|\cdot\|_{\mathcal{A}}$ は \mathcal{A} における全変分をあらわすものとする (後に \mathcal{A} の部分 σ 代数 \mathcal{B} について同じ記号 $\|\cdot\|_{\mathcal{B}}$ を用いるが、同様に理解されたい)。特にこの場合 \mathcal{P} の稠密可算部分集合を $\{P_n: n=1, 2, \dots\}$ とすると、 $\lambda_0 = \sum_{n=1}^{\infty} 2^{-n} P_n$ は \mathcal{P} の *dominate* 測度である。これを *pivotal* 測度という。 σ 代数 \mathcal{B} が \mathcal{P} のどの二つの要素 P, P' の組に対しても十分であるとき、 \mathcal{B} は \mathcal{P} に対して双十分であるという。 \mathcal{P} が *dominated* であれば、 \mathcal{B} が \mathcal{P} に対して双十分であることは十分であるための必要十分条件である (Halmos-Savage [4])。

上に述べた統計の概念を σ 代数列に拡張して考えようというのである。 \mathcal{A} の部分 σ 代数列 $\{\mathcal{A}_n\}$ は単調増大で $\mathcal{A} = \bigvee_{n=1}^{\infty} \mathcal{A}_n$ をみたすとする。 \mathcal{B}_n を \mathcal{A}_n の部分 σ 代数とする ($n=1, 2, \dots$)。 $\{\mathcal{B}_n\}$ が $(\mathcal{P}, \{\mathcal{A}_n\})$ に対して漸近十分であるというのは、 \mathcal{P} のどの要素 P に対しても \mathcal{A}_n 上の確率測度 P_n が存在して ($n=$

1, 2, \dots), 次の二条件をみたすことである: (1) $\mathcal{P}_n = \{P_n: P \in \mathcal{P}\}$ に対して \mathcal{B}_n は十分である, (2) $\forall P (\in \mathcal{P}): \|P_n - P\|_{\mathcal{A}_n} \rightarrow 0$ ([6]ではこの定義に誤りがあった, [7]をみよ). 列 $\{\mathcal{B}_n\}$ が \mathcal{P} の任意の二要素の組に対して漸近十分であるとき, これは漸近双十分であるという. 漸近十分な $\{\mathcal{B}_n\}$ はもちろん漸近双十分である. 以下では漸近十分性と十分性の関係について, 3節 [D-5] で定義した $(p)\text{-}\overline{\lim} \mathcal{B}_n, (p)\text{-}\underline{\lim} \mathcal{B}_n$ を利用して述べ, 十分性と双十分性との関係と同様な関係が漸近十分性と漸近双十分性の間にあることを述べたい

3節 [D-5] で定義した上極限・下極限の概念は Base になる確率測度に依存するから, それが変わるときは記号の中に入れる必要がある. $(1)\text{-}\overline{\lim}_\lambda \mathcal{B}_n, (1)\text{-}\underline{\lim}_\lambda \mathcal{B}_n$ は Base measure が入であることを示す. \mathcal{P} がただ二つの要素だけからなりたつとき, $\{\mathcal{B}_n\}$ が $(\mathcal{P}, \{\mathcal{A}_n\})$ に対して漸近十分ならば, $(1)\text{-}\overline{\lim}_\lambda \mathcal{B}_n$ は \mathcal{P} に対して十分である, ここで λ は \mathcal{P} の dominate 測度とする. したがって一般に dominated な \mathcal{P} についても同様なことがなりたつ (Kudo [6]) が, さらに \mathcal{A} が σ -generated という条件を加えると, 次の4つは同等である (λ_0 : pivotal 測度):

(a) $\{\mathcal{B}_n\}$ は $(\mathcal{P}, \{\mathcal{A}_n\})$ に対して漸近十分,

(b) $\forall P (\in \mathcal{P}): e_{\lambda_0} \left(\frac{dP}{d\lambda_0}, \mathcal{B}_n \right) \rightarrow 0$

(c) $\forall P (\in \mathcal{P}): \left\| \frac{dP}{d\lambda_0} - E_{\lambda_0}^{\mathcal{B}_n} \left[\frac{dP}{d\lambda_0} \right] \right\|_{1(\lambda_0)} \rightarrow 0$, ただし

$\|\cdot\|_{1(\lambda_0)}$ は測度空間 $(\Omega, \mathcal{A}, \lambda_0)$ 上の L^1 ノルムを示す。

(d) $(1)\text{-}\lim_{\lambda_0} B_n$ が \mathcal{D} に対して十分 (Kusama [10]).

十分性の場合と同様に漸近十分性についても次のことがなりたつ (Kusama [10]): 上の定理と同じ条件のもとに, 漸近双十分性は十分性の必要十分条件である。

参考文献

- [1] Becker, R.: Ensembles compacts de tribu, Z. Wahrscheinlichkeitstheorie verw. Geb. 29(1974), 229-234.
- [2] Boylan, E.S.: Equiconvergence of martingale, Ann. Math. Statist. 42(1971), 552-559.
- [3] Cramer, H.: Mathematical Methods of Statistics, 1946, Princeton Math. Ser.
- [4] Halmos, P.R. and Savage, L.J.: Application of the Radon-Nikodym theorem to the theory of sufficient statistics, Ann. Math. Statist. 20(1949), 225-241.
- [5] 岩田直子: σ -algebra の列の収束について (修士論文).
- [6] Kudō, H.: On an approximation to a sufficient statistic including a concept of asymptotic sufficiency, Journ. Fac. Sci., Univ. of Tokyo, Sec. I, 17(1970), 273-290.
- [7] ———: Correction to "On an approximation". (同誌掲載予定).
- [8] ———: A note on the strong convergence of σ -algebras, Ann. Prob. 2(1974), 76-83.

- [9] ———: Appendix to [8]. (unpublished)
- [10] Kusama, T.: On approximate sufficiency. (提出中)
- [11] Loeve, M.: Probability Theory, 2nd ed., 1960, Van Nostrand.
- [12] Neveu, J.: Mathematical Foundations of the Calculus of Probability, 1965. Holden-Day.
- [13] ———: Note on the tightness of the metric on the set of complete sub- σ -algebras of a probability space, Ann. Math. Statist., 43(1972), 1369-1371.
- [14] Nghien, D.N.: Convergence forte des esperances conditionnelles et des projecteurs d'un espace de Hilbert, Ann. Inst. Henri Poincaré, Sec. B(1970), 9-13.
- [15] Rogge, L.: Uniform inequalities for conditional expectations, Ann. Prob. 2(1974), 486-489.
- [16] Shintani, T. and Ando, T.: Best approximants in L^1 space, Z. Wahrscheinlichkeitstheorie verw. Geb. 33(1975), 33-39.
- [17] Tomkins, R.J.: On conditional medians, Ann. Prob. 3(1975), 375-379.