

Second Order Asymptotically Optimum Estimation
in Autoregressive Models

赤平 昌文

はじめに

最近、推定の漸近理論において、独立な確率変数に基づく推定量の高次の漸近的有効性に関する統一理論がつけられた (e.g. [3], [4], [5]). ここでは独立でない場合の例として、1次の自己回帰過程における係数の推定について考察する。これまでは、 $X_t = \theta X_{t-1} + U_t$ ($t=1, 2, \dots$) となる自己回帰過程 $\{X_t\}$ について考えた ([1], [2], [6]). ここで $\{U_t\}$ はいずれも平均 0, 分散 σ^2 をもつ密度関数 f に従う独立な確率変数の列で、 $|\theta| < 1$ とする。このとき θ の推定量が 2 次の漸近的有効となるための十分条件が求められ、さらに f が正規分布の密度関数ならば最小二乗推定量 (LSE) が 2 次の漸近的有効となることが示された。ここでは従来得られた結果をまとめ、さらに次のようなもう少し一般の自己回帰過程 $\{X_t\}$ について考察する。 $X_t - \mu = \theta (X_{t-1} - \mu) + U_t$ ($t=1, 2, \dots$).

ただし $\{U_t\}$ は いずれも正規分布 $N(0, 1)$ に従う独立な確率変数の列とし、 X_0 は $N(\mu, 1/(1-\theta^2))$ に従う確率変数で U_t とは独立とする。ここで $|\theta| < 1$ と仮定する。このとき θ の 2 次の漸近的有効推定量を求める。

§1. 定義.

$(\mathcal{X}, \mathcal{B})$ を標本空間、 (\mathcal{H}) をパラメータ空間で R^1 の開集合とする。 $(\mathcal{X}, \mathcal{B})$ の T 個の直積空間を $(\mathcal{X}^{(T)}, \mathcal{B}^{(T)})$ で表わす。

$(\mathcal{X}^{(T)}, \mathcal{B}^{(T)})$ 上に次のような確率測度の族 $\{P_{\theta, T} : \theta \in (\mathcal{H})\}$ を考える ($T=1, 2, \dots$).

$$P_{\theta, T}(B^{(T)}) = P_{\theta, T+1}(B^{(T)} \times \mathcal{X}), \quad \forall B^{(T)} \in \mathcal{B}^{(T)}.$$

$\mathcal{X}^{(T)}$ から (\mathcal{H}) の中への $\mathcal{B}^{(T)}$ -可測関数の列 $\{\hat{\theta}_T\}$ を θ の推定量とよぶ。以下の議論では簡単のために $\{\hat{\theta}_T\}$ を $\hat{\theta}_T$ と書くことにする。ある正数の単調増加列 $\{c_T\}$ ($\lim_{T \rightarrow \infty} c_T = \infty$) に対して、推定量 $\hat{\theta}_T$ が $\{c_T\}$ -一致推定量であるとは、任意の $\varepsilon > 0$ と任意の $\vartheta \in (\mathcal{H})$ に対して、十分小さな $\delta > 0$ と十分大きな $L > 0$ が存在して

$$\lim_{T \rightarrow \infty} \sup_{\theta: |\theta - \vartheta| < \delta} P_{\theta, T} \{c_T |\hat{\theta}_T - \theta| \geq L\} < \varepsilon$$

が成り立つことである。

これからの議論では $c_T = \sqrt{T}$ の場合のみを考えている。

$\{\sqrt{T}\}$ -一致推定量 $\hat{\theta}_T$ が 2 次の漸近的中央値不偏 (AMU) で

あるとは、任意の $\theta \in \Theta$ に対して、 $\delta > 0$ が存在して

$$\lim_{T \rightarrow \infty} \sup_{\theta: |\theta - \theta_0| < \delta} \sqrt{T} \left| P_{\theta, T} \{ \hat{\theta}_T \leq \theta \} - \frac{1}{2} \right| = 0 ;$$

$$\lim_{T \rightarrow \infty} \sup_{\theta: |\theta - \theta_0| < \delta} \sqrt{T} \left| P_{\theta, T} \{ \hat{\theta}_T \geq \theta \} - \frac{1}{2} \right| = 0$$

が成り立つことと定義する。

2次のAMU推定量 $\hat{\theta}_T$ について $F_{\theta}(a) + \frac{1}{\sqrt{T}} G_{\theta}(a)$ が2次の漸近分布であるとは

$$\lim_{T \rightarrow \infty} \sqrt{T} \left| P_{\theta, T} \{ \sqrt{T} (\hat{\theta}_T - \theta) \leq a \} - F_{\theta}(a) - \frac{1}{\sqrt{T}} G_{\theta}(a) \right| = 0$$

となることであると定義する。 $\hat{\theta}_T$ を2次の漸近分布 $F_{\theta}(\cdot) + \frac{1}{\sqrt{T}} G_{\theta}(\cdot)$ をもつ2次のAMU推定量とする。 $\theta_0 \in \Theta$ を任意に固定する。

このとき帰無仮説 $H^+ : \theta = \theta_0 + (a/\sqrt{T})$ ($a > 0$)、対立仮説 $K : \theta = \theta_0$ なる検定問題を考える。 \mathcal{U}_2 を2次のAMU推定量全体の集合とし、 $\Phi_{\frac{1}{2}}$ を $E_{\theta_0 + (a/\sqrt{T}), T}(\phi_T) = \frac{1}{2} + o(\frac{1}{\sqrt{T}})$ を満たす検定関数列 $\{\phi_T\}$ の集合とする。 $A_{\hat{\theta}_T, \theta_0} = \{c_T(\hat{\theta}_T - \theta_0) \leq a\}$

とおくと、 $P_{\theta_0 + (a/\sqrt{T}), T}(A_{\hat{\theta}_T, \theta_0}) = \frac{1}{2} + o(\frac{1}{\sqrt{T}})$ となるから

$A_{\hat{\theta}_T, \theta_0}$ の定義関数 (indicators) の列 $\{\chi_{A_{\hat{\theta}_T, \theta_0}}\}$ は $\Phi_{\frac{1}{2}}$ に属する。何故ならば $\hat{\theta}_T$ が \mathcal{U}_2 に属しているからである。もし

$$\sup_{\{\phi_T\} \in \Phi_{\frac{1}{2}}} \overline{\lim}_{T \rightarrow \infty} \sqrt{T} \left\{ E_{\theta_0, T}(\phi_T) - F_{\theta_0}^+(a) - \frac{1}{\sqrt{T}} G_{\theta_0}^+(a) \right\} = 0$$

ならば、 $F_{\theta_0}(a) \leq F_{\theta_0}^+(a)$ でさらに $F_{\theta_0}(a) = F_{\theta_0}^+(a)$

のときは $G_{\theta_0}(a) \leq G_{\theta_0}^+(a)$ となる。

次に、帰無仮説 $H^- : \theta = \theta_0 + (a/\sqrt{T})$ ($a < 0$)、対立仮説 $K : \theta = \theta_0$ なる検定問題を考える。上の場合と同様にして、もし

$$\inf_{\{\phi_T\} \in \Phi_{1/2}} \lim_{T \rightarrow \infty} \sqrt{T} \{ E_{\theta_0, T}(\phi_T) - F_{\theta_0}^-(a) - G_{\theta_0}^-(a) \} = 0$$

ならば、 $F_{\theta_0}(a) \geq F_{\theta_0}^-(a)$ でさらに $F_{\theta_0}(a) = F_{\theta_0}^-(a)$ のときは $G_{\theta_0}(a) \geq G_{\theta_0}^-(a)$ となる。

2次のAMU推定量 $\hat{\theta}_T$ が2次の漸近的有効であるとは、 $\hat{\theta}_T$ の2次の漸近分布が2次のAMU推定量の2次の漸近分布の限界を attain すること、すなわち各 $\theta \in \mathbb{H}$ に対して

$$F_{\theta}(a) = \begin{cases} F_{\theta}^+(a) & (a > 0); \\ F_{\theta}^-(a) & (a < 0); \end{cases} \quad G_{\theta}(a) = \begin{cases} G_{\theta}^+(a) & (a > 0); \\ G_{\theta}^-(a) & (a < 0) \end{cases}$$

となることであると定義する。ここで $a=0$ については、

2次のAMUの条件から $F_{\theta}(0) = F_{\theta}^+(0) = F_{\theta}^-(0)$, $G_{\theta}(0) = G_{\theta}^+(0) = G_{\theta}^-(0)$ である。

$\hat{\theta}_T^*$ を上の意味で2次の漸近的有効推定量とし、 $\hat{\theta}_T$ を任意の2次のAMU推定量とする。このとき任意の $\theta \in \mathbb{H}$, $a > 0$, $b > 0$ に対して

$$\lim_{T \rightarrow \infty} \sqrt{T} [P_{\theta, T} \{-a < \sqrt{T}(\hat{\theta}_T^* - \theta) < b\} - P_{\theta, T} \{-a < \sqrt{T}(\hat{\theta}_T - \theta) < b\}] \geq 0$$

が成り立つ。

§ 2. 結果.

この節において 次の(I), (II), (III)の場合にわけて議論を進める。(I)は X_0 の初期条件がない場合、(II)は X_0 の初期条件が存在する場合、(III)未知の平均(局外パラメータ)が

存在する場合. これからは $\mathcal{X} = R^1$, $\mathbb{H} = (-1, 1)$ と仮定する.

(I) 次のような自己回帰過程 $\{X_t\}$ について考察する.

$$(2.1) \quad X_t = \theta X_{t-1} + U_t \quad (t=1, 2, \dots, T),$$

ここで $X_0 = 0$ で $\{U_t\}$ は いずれも平均 0, 分散 σ^2 をもつ密度関数 f に従う独立な確率変数の列とする. いま $|\theta| < 1$ であると仮定する. さらに次のことを仮定する. 任意の $u \in \mathcal{X}$ について $f(u) > 0$ で f は 4 回連続微分可能で $(\partial^4/\partial u^4) \log f(u)$ は有界でかつ

$$\lim_{u \rightarrow \pm\infty} f(u) = \lim_{u \rightarrow \pm\infty} f'(u) = \lim_{u \rightarrow \pm\infty} f''(u) = 0; \quad E_f(U_t^4) < \infty$$

が成り立つ. $\psi(u) = \log f(u)$ とおく. これらの仮定の下で 2 次の AMU 推定量 $\hat{\theta}_n$ が 2 次の漸近的有効であるための十分条件は、 $\hat{\theta}_n$ の 2 次の漸近分布が

$$\Phi\left(\frac{a\sigma\sqrt{I}}{\sqrt{1-\theta^2}}\right) + \phi\left(\frac{a\sigma\sqrt{I}}{\sqrt{1-\theta^2}}\right) \left\{ \frac{a^2\sigma\sqrt{I}\theta}{\sqrt{T}(1-\theta^2)^{3/2}} + \frac{a^2\sqrt{1-\theta^2}\mu_3}{6\sigma\sqrt{IT}(1-\theta^3)} (3J+K) \right\}$$

で与えられることである ([1]). ここで $\Phi(u) = \int_{-\infty}^u \phi(v) dv$ で $\phi(v) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-v^2/2}$ であり $I = E_f[\{\psi'(U)\}^2]$, $J = E_f[\psi'(U)\psi''(U)]$,

$K = E_f[\{\psi'(U)\}^3]$, $\mu_3 = E_f(U^3)$ とする.

θ の LSE $\hat{\theta}_{LS}$ は $(\sum_{t=2}^T X_t X_{t-1}) / \sum_{t=2}^T X_{t-1}^2$ で与えられる. ここで f は正規分布の密度関数と仮定する. $\hat{\theta}_{LS}$ を 2 次の AMU 推定量にするために $\hat{\theta}_{LS}^* = (1 + \frac{1}{T}) \hat{\theta}_{LS}$ と修正すれば、 $\hat{\theta}_{LS}^*$ は 2 次の漸近的有効となる ([1]).

また θ の Yule-Walker 推定量 $\hat{\theta}_{Yw} = (\sum_{t=2}^T X_t X_{t-1}) / \sum_{t=1}^T X_t^2$ について考える. ϕ を正規分布の密度関数と仮定し, $\hat{\theta}_{Yw}$ を 2 次の AMU 推定量となるようにするために $\hat{\theta}_{Yw}^* = (1 + \frac{2}{T}) \hat{\theta}_{Yw}$ と修正すれば, $\hat{\theta}_{Yw}^*$ は 2 次の漸近的有効になる ([6]).

(II) (2.1) の自己回帰過程において, $E(X_0) = 0, V(X_0) = \sigma^2$ で $\{U_t\}$ はいずれも平均 0, 分散 1 をもつ確率変数の列で, 各 t について U_t と X_0 は独立であるとする. X_0 の初期条件を考慮していることが (I) の場合と異なるところである.

(X_0, X_1, \dots, X_T) の同時密度関数を $L(\theta) = L(\theta; x_0, x_1, \dots, x_T)$ とする. このとき次のことを仮定する.

(A.1). $\{(x_0, x_1, \dots, x_T) : L(\theta; x_0, x_1, \dots, x_T) > 0\}$ が θ に依存しない.

(A.2). a. a. (x_0, x_1, \dots, x_T) について $L(\theta)$ は θ に関して 3 回連続微分可能.

(A.3). 各 $\theta \in \Theta$ について

$0 < I(\theta) = \frac{1}{T} E_{\theta} [\{\frac{\partial}{\partial \theta} \log L(\theta)\}^2] = -\frac{1}{T} E_{\theta} [\frac{\partial^2}{\partial \theta^2} \log L(\theta)] < \infty$ が成り立つ.

(A.4). $J(\theta) = \frac{1}{T} E_{\theta} [\{\frac{\partial^2}{\partial \theta^2} \log L(\theta)\} \{\frac{\partial}{\partial \theta} \log L(\theta)\}]$;

$$K(\theta) = \frac{1}{T} E_{\theta} [\{\frac{\partial}{\partial \theta} \log L(\theta)\}^3]$$

が存在してかつ

$$\frac{1}{T} E_{\theta} [\frac{\partial^3}{\partial \theta^3} \log L(\theta)] = -3J(\theta) - K(\theta)$$

が成り立つ.

θ の最尤推定量 (MLE) を $\hat{\theta}_{ML}$ で表わすと $\hat{\theta}_{ML}$ の stochastic

expansion は

$$(2.2) \quad \sqrt{T}(\hat{\theta}_{ML} - \theta) = \frac{Z_1(\theta)}{I(\theta)} + \frac{Z_1(\theta)Z_2(\theta)}{I(\theta)^2\sqrt{T}} - \frac{3J(\theta)+K(\theta)}{2I(\theta)^3\sqrt{T}}Z_1(\theta)^2 + o_p\left(\frac{1}{\sqrt{T}}\right)$$

で与えられる。ここで

$$Z_1(\theta) = \frac{1}{\sqrt{T}} \frac{\partial}{\partial \theta} \log L(\theta), \quad Z_2(\theta) = \frac{1}{\sqrt{T}} \left\{ \frac{\partial^2}{\partial \theta^2} \log L(\theta) - E_{\theta} \left[\frac{\partial^2}{\partial \theta^2} \log L(\theta) \right] \right\}$$

とする。

ゆえに $\hat{\theta}_{ML}$ を二次の AMU となるように修正した推定量を $\hat{\theta}_{ML}^*$ とすれば、独立同一分布の場合 ([3]) と同様にして、次の定理を得る。

定理 2.1 ([2]). 条件 (A.1) ~ (A.4) が成り立つと仮定する。このとき $\hat{\theta}_{ML}^*$ は二次の漸近的有効推定量である。

さらに X_0, U_t がそれぞれ正規分布 $N(0, 1/(1-\theta^2)), N(0, 1)$ に従うと仮定する。このような $\{X_t\}$ が定常過程となることは明らかである。このとき MLE $\hat{\theta}_{ML}$ の stochastic expansion は

$$(2.3) \quad \sqrt{T}(\hat{\theta}_{ML} - \theta) = -\frac{2\theta}{\sqrt{T}} + \frac{2\theta(1-\theta^2)}{\sqrt{T}} X_0^2 + \frac{2(1-\theta^2)}{\sqrt{T}} \sum_{t=1}^T U_t X_{t-1} \\ - \frac{(1-\theta^2)^2}{T\sqrt{T}} \left(\sum_{t=1}^T X_{t-1}^2 \right) \sum_{t=1}^T U_t X_{t-1} \\ + \frac{(1-\theta^2)^3 \{3J(\theta) + K(\theta)\}}{2T\sqrt{T}} \left(\sum_{t=1}^T U_t X_{t-1} \right)^2 + o_p\left(\frac{1}{\sqrt{T}}\right)$$

となる。

$E(U_t^3) = 0$ であるから、(2.3) の右辺の 5 番目の項は $T^{-1/2}$ の order までは $\hat{\theta}_{ML}$ の (二次の) 漸近分布に影響しない。また $E(X_0^2 U_t X_{t-1}) = 0$ ($t=1, \dots, T$) であるから、(2.3) の右辺の

2番目の項は $T^{-1/2}$ の order までは $\hat{\theta}_{ML}$ の (2次の) 漸近分布に影響しない。

一方、LSE $\hat{\theta}_{LS} = \frac{\sum_{t=1}^T X_t X_{t-1}}{\sum_{t=1}^T X_{t-1}^2}$ の stochastic expansion は、

$$(2.4) \quad \sqrt{T}(\hat{\theta}_{LS} - \theta) = \frac{2(1-\theta^2)}{\sqrt{T}} \sum_{t=1}^T U_t X_{t-1} - \frac{(1-\theta^2)^2}{T\sqrt{T}} \left(\sum_{t=1}^T X_{t-1}^2 \right) \left(\sum_{t=1}^T U_t X_{t-1} \right) + o_p\left(\frac{1}{\sqrt{T}}\right)$$

で与えられる。よって $\hat{\theta}_{LS}$ を 2次の AMU となるように修正した推定量を $\hat{\theta}_{LS}^*$ とすれば、定理 2.1, (2.2) ~ (2.4) から次の定理を得る。

定理 2.2. ([2]). $\hat{\theta}_{LS}^*$ は 2次の漸近的有効推定量である。

(注意). 上の議論からわかるように、 X_0 の初期条件に無関係に MLE, LSE の 2次の漸近的有効性が成り立つ。しかしながら、 X_0 の初期条件は、MLE の 3次以上の漸近的有効性には影響をおよぼすであろう。

(Ⅲ) 次のような自己回帰過程 $\{X_t\}$ について考察する^(*)

$X_t - \mu = \theta(X_{t-1} - \mu) + U_t$ ($t=1, \dots, T$), ここで $\{U_t\}$ はいずれも正規分布 $N(0, 1)$ に従う独立な確率変数の列とし、 X_0 は $N(\mu, 1/(1-\theta^2))$ に従う確率変数で、各 t について U_t

(*) この model に関する問題提起は小河原正巳先生により行われた。

と独立とする。このような $\{X_t\}$ が定常過程となることは明らかである。いま $|\theta| < 1$ であり、 $\mu = E(X_t)$ ($t=0, 1, 2, \dots$) で $\mu \neq \theta$ と仮定する。 $X'_t = X_t - \mu$ ($t=0, 1, 2, \dots$) とおく。このとき $(X'_0, X'_1, \dots, X'_T)$ の同時密度関数 $L(\theta, \mu)$ は、

$$\begin{aligned}
 (2.5) \quad L(\theta, \mu) &= L(\theta, \mu; x'_0, x'_1, \dots, x'_T) \\
 &= \frac{1}{(2\pi)^{(T+1)/2}} \sqrt{1-\theta^2} \exp \left\{ -\frac{1}{2} \sum_{t=1}^T (x'_t - \theta x'_{t-1})^2 \right. \\
 &\quad \left. - \frac{1}{2} (1-\theta^2) x_0'^2 \right\} \\
 &= \frac{1}{(2\pi)^{(T+1)/2}} \sqrt{1-\theta^2} \exp \left[-\frac{1}{2} \left\{ x_0'^2 + x_T'^2 \right. \right. \\
 &\quad \left. \left. + (1+\theta^2) \sum_{t=1}^{T-1} x_t'^2 - 2\theta \sum_{t=1}^T x'_{t-1} x'_t \right\} \right] \\
 &= \frac{1}{(2\pi)^{(T+1)/2}} \sqrt{1-\theta^2} \exp \left\{ -\frac{1}{2} (\underline{x}' \Sigma^{-1} \underline{x}') \right\}
 \end{aligned}$$

で与えられる。

ここで $\underline{x}' = (x'_0, x'_1, \dots, x'_T)$ と、 Σ^{-1} は

$$(2.6) \quad \Sigma^{-1} = \begin{pmatrix} 1 & -\theta & & & 0 \\ -\theta & 1+\theta^2 & & & \\ & & \ddots & & \\ & & & 1+\theta^2 & -\theta \\ 0 & & & -\theta & 1 \end{pmatrix}$$

なる $(T+1) \times (T+1)$ 行列とする。

(i) θ が既知ならば、 μ の MLE $\hat{\mu}_T$ は

$$\hat{\mu}_T = \frac{1' \Sigma^{-1} \underline{x}'}{1' \Sigma^{-1} 1}$$

で与えられる。ここで $1' = (1, \dots, 1)$ とする。

(2.6)から

$$\hat{\mu}_T = \frac{X_0 + X_T + (1-\theta) \sum_{t=1}^{T-1} X_t}{2 + (1-\theta)(T-2)}$$

と表わされる。そこでもし θ が未知ならば、 θ の一致推定量 $\hat{\theta}_T$ を $\hat{\mu}_T$ の θ のところに代入して得られた

$$\hat{\mu}_T^* = \frac{X_0 + X_T + (1-\hat{\theta}_T) \sum_{t=1}^{T-1} X_t}{2 + (1-\hat{\theta}_T)(T-2)}$$

はまた μ の一致推定量となる。また $\bar{X} = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T X_t$ とおくと

$$\begin{aligned} \hat{\mu}_T^* &= \frac{(1-\hat{\theta}_T)T\bar{X} + (X_0 + \hat{\theta}_T X_T)}{(1-\hat{\theta}_T)T + 2\hat{\theta}_T} \\ &= \frac{\bar{X} + \frac{1}{(1-\hat{\theta}_T)T} (X_0 + \hat{\theta}_T X_T)}{1 + \frac{2\hat{\theta}_T}{(1-\hat{\theta}_T)T}} \end{aligned}$$

であるから $\hat{\mu}_T^* - \bar{X}$ は $T \rightarrow \infty$ のとき 0 に確率収束する。

(ii) μ が既知ならば、 θ の LSE $\hat{\theta}_{LS}$ は

$$(2.7) \quad \hat{\theta}_{LS} = \frac{\sum_{t=1}^T (X_t - \mu)(X_{t-1} - \mu)}{\sum_{t=1}^T (X_{t-1} - \mu)^2}$$

で与えられる。(II) から議論から $\hat{\theta}_{LS}$ を 2 次の AMU となるように修正した推定量は、2 次の漸近的有効推定量となることが示される。

(iii) μ が未知ならば、上の $\hat{\theta}_{LS}$ の μ のかわりに $\bar{X} = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T X_t$ を
代入した推定量

$$\hat{\theta}_{LS}^* = \frac{\sum_{t=1}^T (X_t - \bar{X})(X_{t-1} - \bar{X})}{\sum_{t=1}^T (X_{t-1} - \bar{X})^2}$$

を考える。この推定量 $\hat{\theta}_{LS}^*$ は (θ, μ) の十分統計量の関数になっている。実際、(2.5) から

$$\begin{aligned} L(\theta, \mu) &= \frac{1}{(2\pi)^{(T+1)/2}} \sqrt{1-\theta^2} \exp\left[-\frac{1}{2}\{(x_0-\mu)^2 + (x_T-\mu)^2\right. \\ &\quad \left.+ (1-\theta^2) \sum_{t=1}^{T-1} (x_t-\mu)^2 - 2\theta \sum_{t=1}^T (x_{t-1}-\mu)(x_t-\mu)\}\right] \\ &= \frac{1}{(2\pi)^{(T+1)/2}} \sqrt{1-\theta^2} \exp\left[-\frac{1}{2}\{x_0^2 + x_T^2 - 2\mu(x_0+x_T)\right. \\ &\quad \left.+ 2\mu^2 + (1-\theta^2) \left(\sum_{t=1}^{T-1} x_t^2 - 2\mu \sum_{t=1}^{T-1} x_t + (T-1)\mu^2\right)\right. \\ &\quad \left.- 2\theta \left(\sum_{t=1}^T x_{t-1}x_t - \mu \left(\sum_{t=1}^T x_{t-1} + \sum_{t=1}^T x_t\right) + \mu^2\right)\}\right] \end{aligned}$$

となるから (θ, μ) の十分統計量は

$$S(X_0, X_1, \dots, X_T) = \left(\sum_{t=1}^{T-1} x_t^2, \sum_{t=1}^T x_{t-1}x_t, \sum_{t=1}^{T-1} x_t, X_0, X_T \right)$$

よって与えられるから、 $\hat{\theta}_{LS}^*$ が S の関数であることは明らかである。(2.7) で与えられた $\hat{\theta}_{LS}$ を $\hat{\theta}_{LS} = A_0/B_0$ とおく。ただし $A_0 = \sum_{t=1}^T (X_t - \mu)(X_{t-1} - \mu)$, $B_0 = \sum_{t=1}^T (X_{t-1} - \mu)^2$ とする。

$\hat{\mu}$ を μ の漸近的有効推定量とし、 $\hat{\theta}_{LS}$ の μ のかわりに $\hat{\mu}$ を
代入した推定量を

$$\hat{\theta}_{LS}^{**} = \frac{\sum_{t=1}^T (X_t - \hat{\mu})(X_{t-1} - \hat{\mu})}{\sum_{t=1}^T (X_t - \hat{\mu})^2} = \frac{A_1}{B_1}$$

とあく. ここで $A_1 = \sum_{t=1}^T (x_t - \hat{\mu})(x_{t-1} - \hat{\mu})$, $B_1 = \sum_{t=1}^T (x_t - \hat{\mu})^2$ とする. このとき

$$\begin{aligned}
 (2.8) \quad \sqrt{T}(\hat{\theta}_{LS}^{**} - \hat{\theta}_{LS}) &= \sqrt{T} \left(\frac{A_0}{B_0} - \frac{A_1}{B_1} \right) \\
 &= \frac{\sqrt{T} \{A_0(B_1 - B_0) - (A_1 - A_0)B_0\}}{B_0 B_1} \\
 &= \frac{\sqrt{T} \left\{ \frac{A_0}{T} \frac{1}{T} (B_1 - B_0) - \frac{B_0}{T} \frac{1}{T} (A_1 - A_0) \right\}}{\frac{B_0 B_1}{T^2}}
 \end{aligned}$$

となる. ここで

$$\frac{A_0}{T} = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T (x_t - \mu)(x_{t-1} - \mu) = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T x_t' x_{t-1}';$$

$$\frac{B_0}{T} = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T (x_{t-1} - \mu)^2 = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T x_{t-1}'^2$$

であるから, A_0/T と B_0/T は $T \rightarrow \infty$ のとき, それぞれ $\theta/(1-\theta^2)$ と $1/(1-\theta^2)$ に確率収束することかわかる.

また

$$\begin{aligned}
 (2.9) \quad \frac{1}{T} (B_1 - B_0) &= \frac{1}{T} \left\{ \sum_{t=1}^T (x_{t-1} - \hat{\mu})^2 - \sum_{t=1}^T (x_{t-1} - \mu)^2 \right\} \\
 &= -\frac{2}{T} \sum_{t=1}^T x_{t-1} (\hat{\mu} - \mu) + (\hat{\mu}^2 - \mu^2) \\
 &= (\hat{\mu} - \mu) (\hat{\mu} + \mu - 2\bar{X}_{t-1});
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 (2.10) \quad \frac{1}{T} (A_1 - A_0) &= \frac{1}{T} \left\{ \sum_{t=1}^T (x_t - \hat{\mu})(x_{t-1} - \hat{\mu}) - \sum_{t=1}^T (x_t - \mu)(x_{t-1} - \mu) \right\} \\
 &= -\bar{X}_t (\hat{\mu} - \mu) - \bar{X}_{t-1} (\hat{\mu} - \mu) + (\hat{\mu} - \mu)^2 \\
 &= (\hat{\mu} - \mu) (\hat{\mu} + \mu - \bar{X}_t - \bar{X}_{t-1})
 \end{aligned}$$

となる. ただし $\bar{X}_{t-1} = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T x_{t-1}$, $\bar{X}_t = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T x_t$ とする.

よって (2.8) ~ (2.10) から、十分大きな T に対して

$$\sqrt{T}(\hat{\theta}_{LS}^{**} - \hat{\theta}_{LS}) \sim \frac{\sqrt{T} \left[\frac{\hat{\mu} - \mu}{1 - \theta^2} \{ \theta(\hat{\mu} + \mu - 2\bar{X}_{t-1}) - (\hat{\mu} + \mu - \bar{X}_t - \bar{X}_{t-1}) \} \right]}{\frac{1}{1 - \theta^2} \frac{1}{T} \sum_{t=1}^{T-1} (X_{t-1} - \hat{\mu})^2}$$

となる。ここで $\hat{\mu}$ として \bar{X}_t をとれば、 $\hat{\theta}_{LS}^{**}$ は $\hat{\theta}_{LS}^*$ であり

$$\begin{aligned} \frac{B_1}{T} &= \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T (X_{t-1} - \bar{X}_t)^2 \\ &= \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T (X_t - \mu)^2 - 2(\bar{X}_t - \mu)(\bar{X}_{t-1} - \mu) + (\bar{X}_t - \mu)^2 \end{aligned}$$

となる。また

$$\bar{X}_{t-1} = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T X_{t-1} = \bar{X}_t + \frac{1}{T} (X_0 - X_T)$$

であるから B_1/T は $T \rightarrow \infty$ のとき $1/(1 - \theta^2)$ に確率収束する。ゆえに、十分大きな T に対して

$$\begin{aligned} (2.11) \quad \sqrt{T}(\hat{\theta}_{LS}^* - \hat{\theta}_{LS}) &\sim \frac{\sqrt{T} \left[\frac{\bar{X}_t - \mu}{1 - \theta^2} \{ -\theta(\bar{X}_t - \mu) + (\bar{X}_t - \mu) \} \right]}{\frac{1}{(1 - \theta^2)^2}} \\ &= (1 - \theta)(1 - \theta^2) \sqrt{T} (\bar{X}_t - \mu)^2 \end{aligned}$$

となる。また (2.4) から $\hat{\theta}_{LS}$ の stochastic expansion は、

$$\begin{aligned} (2.12) \quad \sqrt{T}(\hat{\theta}_{LS} - \theta) &= \frac{2(1 - \theta^2)}{\sqrt{T}} \sum_{t=1}^T U_t X'_{t-1} - \frac{(1 - \theta^2)^2}{T\sqrt{T}} \left(\sum_{t=1}^T X'^2_{t-1} \right) \left(\sum_{t=1}^T U_t X'_{t-1} \right) \\ &\quad + o_p\left(\frac{1}{\sqrt{T}}\right) \end{aligned}$$

によって与えられる。

こゝで

$$(2.13) \quad E \left[\frac{1}{\sqrt{T}} \left(\sum_{t=1}^T u_t x'_{t-1} \right) \sqrt{T} \bar{x}'_t \right] = O\left(\frac{1}{T}\right);$$

$$(2.14) \quad E \left[\frac{1}{\sqrt{T}} \left(\sum_{t=1}^T x'_{t-1} \right) \left(\sum_{t=1}^T u_t x'_{t-1} \right) \sqrt{T} \bar{x}'_t \right] = O\left(\frac{1}{T}\right)$$

となる。ただし $\bar{x}'_t = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T x'_t = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T (x_t - \mu) = \bar{x}_t - \mu$ となる。

こゝで $\hat{\theta}_{LS}$ の stochastic expansion は、

$$(2.15) \quad \sqrt{T}(\hat{\theta}_{LS}^* - \theta) = \sqrt{T}(\hat{\theta}_{LS}^* - \hat{\theta}_{LS}) + \sqrt{T}(\hat{\theta}_{LS} - \theta)$$

と考えられる。このとき

$$(2.16) \quad V(\sqrt{T}(\hat{\theta}_{LS}^* - \hat{\theta}_{LS})) = O\left(\frac{1}{T}\right)$$

となるから、(2.11) ~ (2.16) から $\hat{\theta}_{LS}$ と $\hat{\theta}_{LS}^*$ の $T^{-1/2}$ の

order まで (2次の) 漸近分布は等しくなることがわかる。

従って $\hat{\theta}_{LS}^*$ を 2次の AMU となるように修正した推定量を

$\hat{\theta}_{LS}^*$ とすれば、次の定理が成り立つ。

定理 2.3. $\hat{\theta}_{LS}^*$ は 2次の漸近的有効推定量である。

上の議論の途中で漸近的有効推定量 $\hat{\mu}$ として \bar{x}_t をとって
考えたけれども、適当な条件を仮定すれば $\hat{\mu}$ のままで同様の
結論を得ることは可能となるであろう。

References

- [1] Akahira, M. (1975). A note on the second order asymptotic efficiency of estimators in an autoregressive process. Rep. Univ. Electro-Comm., 26, 143-149.
- [2] Akahira, M. (1979). On the second order asymptotic optimality of estimators in an autoregressive process. Rep. Univ. Electro-Comm., 29, 213-218.
- [3] Akahira, M. and Takeuchi, K. (1981). Asymptotic Efficiency of Statistical Estimators: Concepts and Higher Order Asymptotic Efficiency. Lecture Notes in Statistics 7, Springer-Verlag, New York-Heidelberg-Berlin (To be published).
- [4] Ghosh, J.K., Sinha, B.K. and Wieand, H.S. (1980). Second order efficiency of the mle with respect to any bounded bowl-shaped loss function. Ann. Statist., 8, 506-521.
- [5] Pfanzagl, J. and Wefelmeyer, W. (1978). A third order optimum property of the maximum likelihood estimator. J. Multivariate Anal., 8, 1-29.
- [6] Takeuchi, K. and Akahira, M. (1977). Second order asymptotic efficiency in estimation of time series. (In Japanese). Sûrikaisekikenkyûsho Kôkyûroku (Proc. Symp., Res. Inst. Math. Sci., Kyoto Univ.), 312, 109-114.