

Conditional Expectations and Chunnel Operators

東工大理学部 梅垣寿春
同 恩田美恵子

Conditional expectations という概念は、元来確率論における基本的なものであり、これが重要な役割を演じていることは、周知の事実である。これの函数解析的な手法による取扱いはかなり以前（1950年代）よりなされている。例えば文献 [10], [11] 又は [17] 参照。この報告では、初めに古典的な conditional expectations の導入を行い、次にこれの作用素としての特性について述べる。その特性が Averaging Operators として表わされる。一方古くより Reynolds identity という乱流理論より発生した概念があるが、それによる Reynolds Operators について述べ、それと Averaging Operators の関連にふれる。次に chunnel と Averaging Operators の対応関係について論じ、情報理論における

Channel が実は、函数解析における作用素の理論として扱
いうることを述べる。

§ 1. 確率空間上の Conditional Expectations

(Ω, \mathcal{O}, P) を確率測度空間とする。 \mathcal{L}_0 を \mathcal{O} の有限部分
代数。 \mathcal{L}_0 を \mathcal{O} の内の atoms 全体とすると、 (\mathcal{L}_0, P) は有限
確率 (= 完全) 事象系である。このとき

$$P(A/\mathcal{L}_0) = \sum_{B \in \mathcal{L}_0} 1_B P(A \cap B) / P(B)$$

を Conditional probability of $A \in \mathcal{O}$ relative to \mathcal{L}_0 とい
う。ここで 1_B は B の定義函数である。さらにスカラー値
な確率変数 f (= \mathcal{O} -可測函数) に対して

$$E(f/\mathcal{L}_0) = \sum_{B \in \mathcal{L}_0} \frac{1_B}{P(B)} \int_B f(\omega) P(d\omega)$$

とおき、これを Conditional expectations (of f) relative
to \mathcal{L}_0 という。とくに、 $f = 1_A$ とおくと

$$E(1_A/\mathcal{L}_0) = P(A/\mathcal{L}_0)$$

である。Conditional expectations $E(f/\mathcal{L}_0)$ に関する重要な
定式は

$$(1.1) \int_B E(f/\mathcal{L}_0)(\omega) P(d\omega) = \int_B f(\omega) P(d\omega), \quad \forall B \in \mathcal{L}_0$$

である。この式が Conditional expectations の 1 つの characterization である。

以上では \mathcal{L} を Ω の有限な部分代数と仮定したが、この仮定を取り去り、以下、 \mathcal{L} を必ずしも有限でない σ -部分代数であるとす。この \mathcal{L} に対して conditional expectations の導入の式は (1.1) によつて行われる。

定理 1.1. $\forall f \in L^p(\Omega) = L^p(\Omega, \mathcal{L}, P) (1 \leq p \leq \infty)$ に対し 函数 $E(f/\mathcal{L}) \in L^p(\mathcal{L}) = L^p(\Omega, \mathcal{L}, P)$ が一意に定つて、式 (1.1) を満す。

変換 $E(\cdot/\mathcal{L})$: $f \rightarrow E(f/\mathcal{L})$ は線形であり、次の諸条件を満足する。

1° $E(\cdot/\mathcal{L})$ は $L^p(\Omega) \rightarrow L^p(\mathcal{L}) (= L^p(\Omega)$ の閉部分空間) 上への norm one projection である。即ち、

$$\|E(f/\mathcal{L})\|_p \leq \|f\|_p \quad \forall f \in L^p(\Omega)$$

$$E(E(f/\mathcal{L})/\mathcal{L}) = E(f/\mathcal{L})$$

$$2^\circ \quad E(1/\mathcal{L}) = 1 \quad ;$$

$$3^\circ \quad E(\bar{f}/\mathcal{L}) = \overline{E(f/\mathcal{L})} \quad ; \quad E(f/\mathcal{L}) \geq 0 \quad \forall f \geq 0 \quad ;$$

$$4^\circ \quad E(fg/\mathcal{L}) = E(f/\mathcal{L})g, \quad \forall g \in L^\infty(\mathcal{L}) \quad ;$$

$$5^\circ \quad \int_{\Omega} E(f/\mathcal{L})(\omega) P(d\omega) = \int_{\Omega} f(\omega) P(d\omega).$$

これらの内で 1° の不等式の証明は、 $f \in L^p(\Omega)$, $g \in L^q(\mathcal{L})$

$$\left| \int_{\Omega} E(f/\mathcal{L})g P(d\omega) \right| = \left| \int_{\Omega} fg P(d\omega) \right| \leq \|f\|_p \cdot \|g\|_q$$

($1/p + 1/q = 1$) が つねに成立していることから云える。

4° の等式は

$$\int_B E(fg/L) = \int_B fg = \int_B E(f/L)g, \quad \forall B \in \mathcal{L}$$

(ここで " $P(dw)$ " を 省略, 以下同様) が $g = 1_B$.

($B_i \in \mathcal{L}$) のとき成立, 従って $g = \sum \beta_i 1_{B_i}$ ($B_i \in \mathcal{L}$)

のとき成立。故に任意の $g \in L^\infty(\mathcal{L})$ でも成立。 $E(fg/L)$,

$E(f/L)g$ が共に \mathcal{L} -可測からこれらが a.e で一致すること

が分る。等式 4° が実は重要なのである, §2. 参照。

§2. Averaging Operators と Reynolds Operators.

いま, \mathcal{A} を抽象的な $*$ algebra (over complex field) とする (unit $1 \in \mathcal{A}$ を仮定)。今, \mathcal{A} 上で二つの線形作用素 A, R , を考える。

$$(A) \quad A(fg) = Af \cdot Ag, \quad Af^* = (Af)^*$$

$$(R) \quad R(fg) = Rf \cdot Rg + R((f - Rf)(g - Rg))$$

$$Rf^* = (Rf)^*$$

式 (A) を Averaging identity, (R) を Reynolds identity とし, 作用素 A, R , をそれぞれ Averaging Operator, Reynolds Operator とし。

定理 2.1. \mathcal{A} が $*$ algebra \mathcal{A} 上の Averaging operator であり $A1 = 1$ ならば A は Reynolds operator

である。

証明 Averaging identity (A) において $f=1$ とおくと $A^2g = A \cdot Ag = Ag$. また Reynolds identity (R) の両辺で R を A で置き換えると (R) の右辺 [$R=A$ として]

$$= AfAg + A(fg - fAg - Af \cdot g + Af \cdot Ag)$$

$$= AfAg + A(fg) - A(fAg) - A(Af \cdot g) + A(Af \cdot Ag)$$

$$= Af \cdot Ag + A(fg) - Af \cdot Ag - Af \cdot Ag + Af \cdot Ag$$

(等式 (A) 及び $A^2 = A$ による)

$$= A(fg) = \text{等式 (A) の左辺 [} R=A \text{ とする.]}$$

次に定理 2.1 の逆を証明したいのであるが、これは一般の $*\text{ algebra}$ では云えない。当面、吾々が必要とするのは、確率測度空間 (Ω, \mathcal{O}, P) の L^∞ の場合、即ち $\mathcal{A} = L^\infty(\mathcal{O}) = L^\infty(\Omega, \mathcal{O}, P)$ の場合である。この \mathcal{A} は通常の意味で $*\text{ algebra}$ となる。($f, g \in \mathcal{A}$ に対して $f \cdot g(\omega) = f(\omega) \cdot g(\omega)$, $f^*(\omega) = \overline{f(\omega)}$) また $1 \in \mathcal{A}$ であり、 $\mathcal{A}' = L^1(\mathcal{O})$ は Banach 空間 $L^1(\mathcal{O})$ の dual である。(Riesz の定理)。このとき

定理 2.2. $*\text{ algebra } \mathcal{A} = L^\infty(\Omega)$ 上の Reynolds Operator R において、 R の rang $R(\mathcal{A})$ が weakly* closed ならば R は Averaging Operator となる。

証明. $R(\mathcal{A})$ が \mathcal{A} の s.a. subalgebra ($g \in R(\mathcal{A}) \Rightarrow g^* \in R(\mathcal{A})$) なることは、Reynolds identity から明らか

である。 $R(A)$ が weakly* closed (つまり, weak* topology で closed) は, Hilbert 空間 $L^2(\Omega)$ 上の multiplication algebra として weak Topology で closed であることと同等である。これより

$$\exists u (\text{unit element}) \in R(A), \quad = u^*$$

これを用いて R が idempotent となることを示し, 結局, 目標の等式 (A) ($A=R$ とおいた等式) が示せる。

§ 3. Averaging Operators の特性

この § は, Kelley の論文 [9] よりの引用であるが, 実は, 次の § で述べる abstract な information channels の formulation の一つの過程に丁度一致する議論であるので取ってここに説明することにした。

X, Y を compact Hausdorff 空間とし, $C(X), C(Y)$ を連続関数空間, $M(X), M(Y)$ をそれらの dual 空間とする。 $M(X), M(Y)$ は夫々 bounded signed measures 全体のなす Banach 空間と考えられる (norm は, 全変分によって与えられる)。 $L(X, Y)$ を $C(X) \rightarrow C(Y)$ なる bounded linear operators の全体とする。これは, 作用素の norm によって Banach 空間となっている。

定理 3.1. 任意の $B \in L(X, Y)$ を与えるとき,

$\forall y \in Y, \exists m_y \in M(X);$

$$(3.1) \quad (Bf)(y) = \int_X f(x) m_y(dx), \quad \forall f \in C(X)$$

であり, 且つ函数 $m_\cdot : Y \rightarrow M(X)$ は weakly* continuous であり

$$(3.2) \quad \|B\| = \sup \{ \|m_y\| ; y \in Y \}$$

を満足する。逆に上述の連続性と norm 条件をもつ

$\{m_y ; y \in Y\}$ が与えられるとき式 (3.1) によつて一意に作用素 $B \in \mathcal{L}(X, Y)$ が定義される。従つて Y 上で定義され $M(X)$ -valued bdd weakly* continuous な函数 m_y と $B \in \mathcal{L}(X, Y)$ は式 (3.1) によつて一対一 isometric に対応する。

定理 3.2. $B \in \mathcal{L}(X, X)$ が averaging

$$\iff Bf^* = (Bf)^* \quad (f^* \triangleq \bar{f}) \quad \text{or}$$

$$(3.3) \quad (Bf)(x) = (Bf)(y) \quad \text{for } \forall x \in \text{supp}(m_y)$$

証明 $B(fBg) = Bf \cdot Bg$

$$\iff \int f(s) \int g(r) m_s(dr) m_y(ds) = B(fBg)(y) \\ = (Bf)(y)(Bg)(y) = \int f(s) m_y(ds) \int g(r) m_y(dr)$$

$$\iff \int f(s) \left(\int g(r) (m_r - m_s)(dr) \right) m_y(ds) = 0$$

$$\iff \int g(r) (m_y - m_s)(dr) = 0 \quad \forall s \in \text{supp } m_y$$

$$\iff (Bg)(y) = (Bg)(s) \quad \forall s \in \text{supp } m_y$$

§ 4. Channel Operators

$X, Y, C(X), C(Y), M(X), M(Y)$ は前§と同じものとする。 $P(X) (\subset M(X))$ を確率測度の全体 $B(X)$ を bounded Baire 函数の全体とする。 Y に対しても同様。

さて, \rightarrow の triple $[X, \nu, Y]$ が channel である, 或いは ν が channel (distribution) with input X and output Y であるということは, 次の如くして定義される:

$$(c.1) \quad \forall x \in X \text{ に対して } \nu(x, \cdot) \in P(Y)$$

$$(c.2) \quad \forall V \in \mathcal{O}_Y \text{ に対して } \nu(\cdot, V) \text{ は } (X, \mathcal{O}_X) \text{ 上で可測}$$

T を X 上の \rightarrow の homeomorphism, 同様に同じ記号で Y 上の \rightarrow の homeomorphism T を与えておく。Channel $[X, \nu, Y]$ 又は ν が T -定常 (stationary) であるとは, 次の条件 (c.3) を満たすときをいう:

$$(c.3) \quad \nu(x, X) = \nu(Tx, TV) \text{ for } \forall x \in X, V \in \mathcal{O}_Y$$

$\mathcal{C} = \mathcal{C}(X, Y)$ を channels ν with X and Y の全体とし

$\mathcal{C}_T = \mathcal{C}_T(X, Y)$ を $\{\nu \in \mathcal{C}; \nu \text{ は } T\text{-定常}\}$ とすると

$\mathcal{C}, \mathcal{C}_T$ は共に convex 集合となる。

$\Omega = X \times Y$ (直積) とおくとこれも compact Hausdorff 空間で $B(\Omega) = B(X) \otimes B(Y)$ である。 $B_0 = B(X) \otimes \{ \lambda 1_Y \}$

($\{1, y\}$ は Y 上の constant な函数全体) とすると \mathcal{B} は可換な B^* algebra であり \mathcal{B}_0 はその closed な $*$ subalgebra となる。 T は $(Tf)(x, y) = f(Tx, Ty)$ となる。 $\mathcal{A} = \mathcal{A}(\mathcal{B}, \mathcal{B}_0)$ を $\mathcal{B} \rightarrow \mathcal{B}_0$ (onto) なる averaging operators A で $A1 = 1$ かつ

$$(A_0) \quad f_n \downarrow 0 \quad (f_n \in \mathcal{B}) \Rightarrow Af_n \downarrow 0$$

(正の単調連続性) を満たす A の全体: $\mathcal{A}_T = \mathcal{A}_T(\mathcal{B}, \mathcal{B}_0) \cong \{A \in \mathcal{A}; AT = TA \text{ on } \mathcal{B}\}$ とする。このとき

定理 4.1. \mathcal{A} と \mathcal{C} 又は \mathcal{A}_T と \mathcal{C}_T の間に一対一の affine 対応 $A \leftrightarrow \nu$ が存在する:

$$(Af)(x) = \int_Y f(x, y) \nu(x, dy), \quad f \in \mathcal{B}.$$

これによつて channels は可換な B^* algebra からその subalgebra への正の単調連続性をもつ averaging operators のことであり、さらに channels の定常性は averaging operators と shift 変換の可換性によつて表わされる。上述の averaging operators $A \in \mathcal{A}$ または \mathcal{A}_T を channel operator といふ。これらの構成、概念、命題などを非可換の場合にあてに extend されている。このことの論述は小沢正直君の論文 [14] を参照 (観測理論との関連)。

定理 4.1 の対応 $A \leftrightarrow \nu$ によつて channels ν の

エルゴード性が作用素 A の extremal な性質と等価であることが知られる (梅垣 又は 中村八束の論文 [12], [13], [19], 参照)。

§ 5. Banach 空間に値をとる函数の Conditional Expectations

確率空間 (Ω, \mathcal{O}, P) 上の conditional expectations の導入は Radon-Nikodym の定理を用いて行うのであるがこの R-N の定理の成立については、確率空間の場合は何等の懸念を必要としない。これは、考える確率空間が numerical なものを基本にとるからである。ところが多くの場合は確率変数の値が種々な Banach 空間にとらねばならぬ場合がある。そのような函数に対する conditional expectations の導入の必要があるのである、これは numerical の場合同様次のように formulate される。 E を (fixed) Banach 空間, $\Omega = (\Omega, \mathcal{O}, P)$ 上で定義され E に値をとる函数が Bochner の意味で可測なものを \mathcal{O} に関して strong random variable という。そのような f に対して Bochner 積分が定義される。Bochner 可積分な strong random variables の全体を $L^1(\Omega; E)$ で表わす。これに対して Conditional Expectations $E[f/\mathcal{L}]$

(\mathcal{L} は Ω の σ -subalg.) が導入される。

$\forall f \in L^1(\Omega; \mathbb{R})$ に対して

(i) $E[f/\mathcal{L}]$ は \mathcal{L} に関して strong random variable
でかつ Bochner 可積分

(ii) $\int_B E[f/\mathcal{L}](\omega) P(d\omega) = \int_B f(\omega) P(d\omega)$ for $B \in \mathcal{L}$

ここで積分は Bochner sense である。このような Banach space valued な函数の conditional expectation の存在は常に成立する。この証明は、[6] 及び [19] など参照。

Conditional expectations の導入の次に函数解析的手法の活動が可能なのは martingales の構成である。これは確率論において重要である stochastic process の一つであるが、これを函数解析の枠組に入れて捉えることが可能となる。この詳述はここでは省略する。論文 [4], [6], および [21] など参照されたい。

§6. Appendix. Reynolds operators and 積分作用素としての記述.

一つの流体を考え、その時刻 t における速度成分を $u(x, t)$ とする (x は位置の座標, t は time)。これに対して積分

$$R_T u = \frac{1}{2T} \int_{-T}^T u(x, t+\tau) d\tau \triangleq \bar{u}(x, t)$$

を考える。これは *time - interval* $[t-T, t+T]$ における $u(x, t)$ の平均である。一般に流体の速度成分を数学的に記述するために、それら $x =$ 変数 x と t についての連続函数 $u(x, t)$ によつて表わす場合が多い。このような連続函数全体 \mathcal{C} とすると $R = R_T$ は $\mathcal{C} \rightarrow \mathcal{C}$ (into) の線型変換であり

$$R1 = 1 ; \quad Ru \geq 0 \quad \text{if} \quad u \geq 0$$

$Ru_n \rightarrow Ru$ if $u_n \rightarrow u$, in uniform, を満足する。さらに R は、任意の推移変換と可換である。

$$L_{a,b} : u(x, t) \rightarrow u(x+a, t+b) \quad \text{and} \quad RL_{a,b} = L_{a,b}R.$$

Reynolds はその流体の乱流の理論の point になつてゐる方程式を次のように説定した:

$$\overline{uv} = \bar{u} \cdot \bar{v} + \overline{u^c \cdot v^c} \quad (u^c = u - \bar{u}, \quad v^c = v - \bar{v})$$

これを作用素 R ($Ru = \bar{u}$) によつて表わすと、これが Reynolds の等式 (R) となる。容易にわかるがこの等式は次の等式と同等である

$$(R') \quad R(Rf \cdot g + Rf \cdot g) = Rf \cdot Rg + R(Rf \cdot Rg).$$

Reynolds operators と Averaging Operators の定義は § 2 を参照することし 一般に $R1 = 1$ を満たす Reynolds operator R の Averaging Operator とはならない興味ある例が Kampé de Fériet の論文 [8] にある。

いま常微分方程式

$$(6.1) \quad \frac{dy}{dt} + y = f$$

を考える。これは境界条件 $\lim_{t \rightarrow +\infty} f(t) = \lim_{t \rightarrow +\infty} g(t) = \text{const}(f)$

の下で unique solution をもつ:

$$(6.2) \quad g = e^{-t} \int_{-\infty}^t f(\lambda) e^{\lambda} d\lambda.$$

$\mathcal{C}_1 \triangleq \{ \text{real line 上の連続函数 } f \text{ で } \exists \lim_{t \rightarrow +\infty} f(t) = \lim_{t \rightarrow +\infty} f(t) \text{ の全体} \}$

とすると, $\forall f \in \mathcal{C}_1$ に対して (1) の解 $g \in \mathcal{C}_1$ が unique に定まることが知られるわけで, その g を Rf とおく。 R は

$\mathcal{C}_1 \rightarrow \mathcal{C}_1$ (into) の positive linear operator で $R1 = 1$ を満たすことは容易にわかるが等式 (R'), 従って (R)

を満すことももう少し計算すれば云える (cf. Dubreil - Jacotin の論文 [3])。然るに, この R は $R^2 \neq R$ である。なぜなら $D = (d/dt + 1)$ とおくと

$$(6.1) \Leftrightarrow DRf = f \quad \forall f \in \mathcal{C}_1$$

もし $R^2 = R \Rightarrow R^2f = Rf, DR^2f = DRf$. この左辺 = Rf , 右辺 = f . $\therefore \forall f \in \mathcal{C}_1$ が R の不動点となり矛盾。一方

$$\lim_{T \rightarrow +\infty} \frac{1}{2T} \int_{-T}^T u(t+\tau) d\tau = (Au)(t), \quad \forall u \in \mathcal{C}_1$$

はつねに存在する。これが linear, pos, $A1 = 1$ は clear. 更に等式 $A(fAg) = AfAg$ が成立する。これを示すた

めには, $A^2 = A$ on C_1 を示せばよい. $\forall f \in C_1$ に対して

$$\frac{1}{4TT'} \int_{-T}^T \int_{-T'}^{T'} f(t+s+r) ds dr = \frac{1}{4TT'} \int_{-T}^T \int_{-T'+s}^{T+s} f(t+r) dr ds$$

ここで $T \rightarrow \infty$, $T' \rightarrow -\infty$ とすると

$$[\text{上式の左辺}] \longrightarrow (A A f)(t)$$

$$[\text{上式の右辺}] \longrightarrow (A f)(t)$$

となり $A^2 = A$ が成立する。

References

- [1] G. Birkhoff, Lattice in Applied Math. Symposium in Lattice, 1960.
- [2] S. D. Chatterji, Martingale Convergence and the Radon-Nikodym Theorem in Banach Spaces, Math. Scand. 23 (1968), 21-41.
- [3] Dubreil-Jacotin, Colloque d'Algebre Superieure du C. B. R. M. December, (1956).
- [4] F. Hiai, Radon-Nikodym Theorems for Set-valued Measures, Research Reports on Information Sciences, Series A: Mathematical Science. Tokyo Instit. of Tech. (1976), No. A-32.
- [5] E. Hille and R. S. Phillips, Functional Analysis and Semi-Groups, AMS Colloq. Pub. 31 (1957).
- [6] Mieko Hirahara, On the Generalized Radon-Nikodym Theorems and Riesz's Representation Theorems. M. A. Thesis (1972), 2, 30 pp.
- [7] Y. Kakiyama, Information Channels between Compact Groups, Res. Reports on Inf. Sci. Ser. A, Math. Sci. Tokyo Inst. Tech. (1976), No. A-28.
- [8] Kampé de Férisset, Proc. Akad. Wet. Amsterdam, Vol. 53 (1951).
- [9] J. L. Kelley, Averaging Operators $C_\infty(X)$, Illinois J. Math., Vol. 2

- (1958), pp. 214-223.
- [10] S-T C. Moy, Characterizations of Conditional Expectation as a Transformation on Function Spaces, *Pacific J. Math.* 4 (1954), 47-65.
 - [11] M. Nakamura and T. Turumaru, Expectations in an Operator Algebra, *Tōhoku Math. J.* 6 (1954).
 - [12] Y. Nakamura, Measure Theoretic Construction for Information Theory, *Kōdai Math. Sem. Rep.* Vol. 20 (1968).
 - [13] Y. Nakamura, Ergodicity and Capacity of Information Channels with Noise Sources, *J. Math. Soc. Japan*, Vol. 27 (1975), pp. 213-221.
 - [14] M. Ozawa, Channel Operators and Quantum Measurements, *Research Reports on Information Sciences, Series A: Mathematical Science. Tokyo Institute of Tech.* (1976), No. A-29 and A-30.
 - [15] O. Reynolds, *Trans. Roy. Soc.* Vol. A 186 (1894).
 - [16] R. Schatten, A Theory of Cross-Spaces. *Ann. Math. Studies.* 26 (1950).
 - [17] H. Umegaki, Conditional Expectation in an Operator Algebra, *Tōhoku Math. J.* 6 (1954), 177-181; II, *Ibid* 8 (1956), 86-100; III, *Kōdai Math. Sem. Rep.* 11 (1959); IV, *Ibid* 14 (1962), 59-85.
 - [18] H. Umegaki and A. T. Bharucha-Reid, Banach Space-valued Random Variables and Tensor Product of Banach Spaces, *J. Math. Analysis and Appls.* 31 (1970), 49-67.
 - [19] H. Umegaki, Representations and Extremal Properties of Averaging Operators and their Applications to Information Channels, *J. Math. Analysis and Appls.* Vol. 25 (1969), pp. 41-73.
 - [20] H. Umegaki, Absolute Continuity of Information Channels, *J. Multivariate Analysis*, Vol. 4 (1974), pp. 382-400.
 - [21] H. Umegaki and M. Onda, Martingales and Optimal Functions (Under the Preparation).