確率数理要論 (1)

講義内容

1. 確率空間
2. 確率変数と期待値（単調収束定理・Fatouの補題・優収束定理）
3. 独立性と大数の法則
4. 確率変数の弱収束（Portmanteauの定理）
5. 特性関数と中心極限定理
6. 条件付き期待値
7. Poisson過程（Gamma, Levy, Dirichlet過程）
8. Brown運動
9. Gauss過程と機械学習応用（Karhunen-Loeve展開，再生核ヒルベルト空間）
10. 確率積分（伊藤積分）
11. マルチンゲール
12. 伊藤の公式
13. 確率微分方程式

参考書

- 舟木直久「確率論」
- 佐藤坦「測度から確率」
- 伊藤清「確率論」
- Durrett「Probability, Theory and Exchange」
- Resnick「A Probability Path」
- Dudley「Real Analysis and Probability」

1. 確率空間

Ω：標本空間　（空間）

- 想定できる結果を全て集めたもの
- 要素 $\omega\in\Omega$ で実際に何が起きたかを表現

$\omega\in\Omega$：標本点　（標本，根元事象）

$A\subset\Omega$：事象

Ex.
- 一定期間に届くメールの件数：$\Omega=\{0,1,2,3,\dots\}$
- 無限回のコイン投げ：$\Omega=\{\omega=(\omega_1,\omega_2,\omega_3,\dots)\mid \omega_i\in\{0,1\}\}$

これから事象の確率を定めてゆく．

Def（σ-加法族，完全加法族）

Ω の部分集合を要素とする集合族 $\mathcal{F}$ が次をみたすとき．
$\mathcal{F}$ を σ-加法族（完全加法族）と呼ぶ．

(1) $\phi\in\mathcal{F}$

(2) $A\in\mathcal{F}\Rightarrow A^c\in\mathcal{F}$

(3) [σ-加法性]

$$A_i\in\mathcal{F}\ (i=1,2,\dots)\Rightarrow \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i\in\mathcal{F}$$

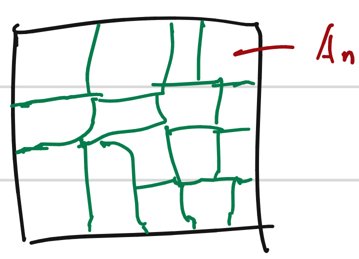
可算個
（非可算和までは要求しない）

//

任意の集合 $A\subset\Omega$ 上に確率を定めようとすると，
矛盾が生じることがある（ルベーグ非可測集合：
$P(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n)=1$，$P(A_n)=0$ で
$P(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n)\neq\sum_{n=1}^{\infty} P(A_n)$ となる）

↓

矛盾が生じない範囲に
限定して確率を定める．
確率が矛盾なく定まっている事象の集まり
を用意する．それがσ-加法族．



Ωと$\mathcal{F}$の組$(\Omega, \mathcal{F})$を可測空間と言う。
$\mathcal{F}$の元を可測集合と言う。

σ-加法族の中でも特に重要なのが、次のBorel集合族。

Def (Borel集合族)

S:位相空間

Sの開集合を全て含む最小のσ-加法族を Borel集合族と言う

後述

$\mathcal{B}(S)$と書く。

Borel集合族の元をBorel集合と言う。

Def (確率測度)

$(\Omega, \mathcal{F})$:可測空間

集合関数 $P: \mathcal{F} \to \mathbb{R}$ が以下をみたすとき、Pを確率測度と言う。

(1) $0 \leq P(A) \leq 1 \quad (\forall A \in \mathcal{F})$

(2) $P(\Omega) = 1$

(3) $A_1, A_2, A_3 \cdots \in \mathcal{F}$ が $A_i \cap A_j = \phi \ (i \neq j)$ をみたすなら、

$$P\left(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i\right) = \sum_{i=1}^{\infty} P(A_i) \qquad [\sigma\text{-加法性}]$$

(有限と無限を矛盾なくつなぐのに必要。e.g., 積分、極限)

$P(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i)$が定義されるためには $\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \in \mathcal{F}$ が必要 ($\mathcal{F}$のσ-加法性)

Pが$(\Omega, \mathcal{F})$上の確率測度のとき、
$(\Omega, \mathcal{F}, P)$を確率空間と言う

Ex.

(1) サイコロ

$\Omega = \{1, 2, \cdots, 6\}$

$P(\{\omega\}) = \frac{1}{6}$

$P(\{\omega \leqq 3 \mid \omega \in \Omega\}) = P(\{1,2,3\})$

($P(\omega \leqq 3)$ とも書く) $= P(\{1\}) + P(\{2\}) + P(\{3\})$

$= \frac{1}{2}$

(2) $\Omega = \{0, 1, 2, 3, \cdots\}$

$A \subset \Omega$ に対し、

$$P(A) = \sum_{\omega \in A} \frac{\lambda^\omega}{\omega!} e^{-\lambda}$$

は確率測度 (Poisson分布)

※ 一般に可算集合 Ω のとき、$0 \leqq h(\omega) \leqq 1$ かつ $\sum_{\omega \in \Omega} h(\omega) = 1$ である $h: \Omega \to \mathbb{R}$ に対し、

$P(A) = \sum_{\omega \in A} h(\omega)$ は確率測度

Cor

$(\Omega, \mathcal{F}, P)$: 確率空間

以下が成り立つ:

(1) $P(\phi) = 0$

(2) (有限加法性)

$A_i \in \mathcal{F}$ $(i = 1, 2, \cdots, n)$

$A_i \cap A_j = \phi$ $(i \neq j)$

$$\Longrightarrow P\left(\bigcup_{i=1}^{n} A_i\right) = \sum_{i=1}^{n} P(A_i)$$

(3) $P(A^c) = 1 - P(A)$

(4) $A \subset B \Longrightarrow P(A) \leqq P(B)$ (単調性)

(5) $A_1 \subset A_2 \subset \cdots$

$$\Rightarrow P\left(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i\right) = \lim_{n\to\infty} P(A_n)$$

(6) $A_1 \supset A_2 \supset \cdots$

$$\Rightarrow P\left(\bigcap_{i=1}^{\infty} A_i\right) = \lim_{n\to\infty} P(A_n)$$

→ 確率の連続性

(今後色々な定理の証明で用いる.)

(7) $A_1, A_2, \cdots \in \mathcal{F}$, $A_i \cap A_j = \phi \ (i \neq j)$ とは限らない

$$P\left(\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i\right) \leqq \sum_{i=1}^{\infty} P(A_i)$$

//

(証明は省略. 自分でチェック)

◎ "最小の σ-加法族" について.

Lem

$(\mathcal{F}_u)_{u\in\mathcal{U}}$: σ-加法族の族 (非可算濃度も許す)

$\Rightarrow \bigcap_{u\in\mathcal{U}} \mathcal{F}_u = \mathcal{F}$ もまた σ-加法族 //

Proof

(1) $\forall u \in \mathcal{U}$ について $\Omega \in \mathcal{F}_u$ なので, $\Omega \in \mathcal{F}$ でもある.

(2) $A \in \mathcal{F} \Rightarrow \forall u \in \mathcal{U}$ で $A \in \mathcal{F}_u$

$\Rightarrow \forall u \in \mathcal{U}$ で $A^c \in \mathcal{F}_u$

$\Rightarrow A^c \in \mathcal{F}$

(3) $A_i \in \mathcal{F} \ (\forall i = 1, 2, \cdots) \Rightarrow \forall u \in \mathcal{U}$ で $A_i \in \mathcal{F}_u \ (\forall i)$

$\Rightarrow \forall u \in \mathcal{U}$ で $\bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \in \mathcal{F}_u$ (∵ σ-加法性)

$\Rightarrow \bigcup_{i=1}^{\infty} A_i \in \mathcal{F}$ //

あるΩの部分集合族$\mathcal{A}$に対し、
$\mathcal{A}$を含む最小のσ-加法族が定義できる：

$$\sigma(\mathcal{A}) := \bigcap_{\mathcal{F}:\,\mathcal{A}\text{を含む}\sigma\text{-加法族}} \mathcal{F}$$

例：Borel集合族は、全Sの開集合を集めた$\mathcal{A}$に対し、
$\mathcal{B}(S) = \sigma(\mathcal{A})$で与えられる。

これ以降、$(\Omega, \mathcal{F}, P)$は与えられているものとする。
(構成のしかたは考えない)
しかし、以下のようにして構成することができる。

Def (集合半代数)

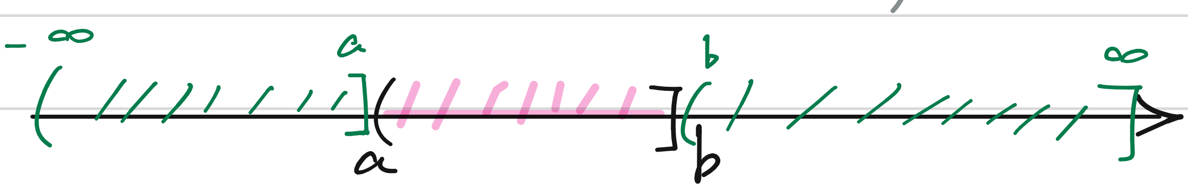
集合族$\mathcal{S}$が集合半代数 $\Longleftrightarrow$

(1) $\phi, \Omega \in \mathcal{S}$
(2) $A, B \in \mathcal{S} \Rightarrow A \cap B \in \mathcal{S}$
(π-システム)
(3) $A \in \mathcal{S}$なら、A^cは互いに排反な有限個の集合
$B_1, \dots, B_n \in \mathcal{S}$に分割される：

$$A^c = \bigcup_{i=1}^{n} B_i \quad (B_i \in \mathcal{S},\ B_i \cap B_j = \phi\ (i \neq j))$$

//

例：$\Omega = \mathbb{R}$, $\mathcal{S} = \{(a, b] \mid -\infty \leq a \leq b \leq \infty\}$ は集合半代数
(半開区間)
(正確には$b=\infty$のときは(a, b))



Thm (Hopfの拡張定理(の一般化))

集合半代数 $\mathcal{S}$ 上の σ-加法的な集合関数 $P: \mathcal{S} \to [0,1]$ で $P(\Omega)=1$ をみたすものは $\sigma(\mathcal{S})$ 上の確率測度へ一意に拡張できる。 //

※ P が $\mathcal{S}$ 上 σ-加法的：

$A_i \cap A_j = \phi\ (i \neq j)$ なる $A_n \in \mathcal{S}\ (n=1,2,\cdots)$ が $\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathcal{S}$ なら、

$$P(\underbrace{\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n}_{\in \mathcal{S}}) = \sum_{n=1}^{\infty} P(\underbrace{A_n}_{\in \mathcal{S}}).$$

例： $\Omega = \mathbb{R}$，後述の分布関数を用いて

$$P((a,b]) = F(b) - F(a)$$

とすれば、 $\mathcal{S} = \{(a,b] \mid -\infty \leq a \leq b \leq \infty\}$ 上の σ-加法的な集合関数が得られる。

さらに、

$$\mathcal{B}(\mathbb{R}) = \sigma(\mathcal{S})$$ チェックせよ。

も成り立つ。

よって、P は $\mathcal{B}(\mathbb{R})$ 上の確率測度に一意に拡張される。 //

◦ 実数軸上の確率測度

$\Omega = \mathbb{R}$

$\mathcal{F} = \mathcal{B}(\mathbb{R})$　　($\mathbb{R}$上のBorel集合族)

P : $(\Omega, \mathcal{F})$上の確率測度

(以後、$\mathbb{R}$上のσ-加法族はBorel集合族を考える)

<u>Def</u> (累積分布関数)

$$F(x) = P((-\infty, x]) = P(\{\omega \in \mathbb{R} \mid -\infty < \omega \leq x\}) \quad (x \in \mathbb{R})$$

を (累積)分布関数 と呼ぶ。

//

<u>Lem</u> (分布関数の性質)

(1) Fは単調非減少　($F(x) \leqq F(y)$ for $x \leqq y$)

(2) Fは右連続：

$$\lim_{x \downarrow y} F(x) = F(y)$$

(逆は成立たない。$\lim_{x \nearrow y} F(x) \neq F(y)$)

(3) $\lim_{x \to -\infty} F(x) = 0$,　$\lim_{x \to +\infty} F(x) = 1$

//

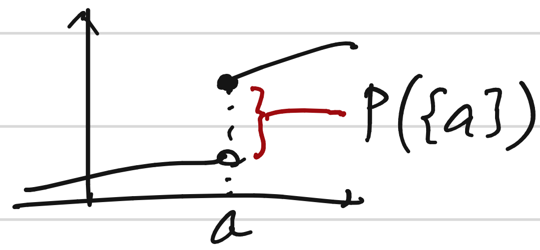
(証明は確率の連続性からすぐに示せる。)

逆に(1)〜(3)の性質をもつ$\mathbb{R}$上の関数Fが与えられれば対応する$\mathcal{B}(\mathbb{R})$上の確率測度が一意に定まる。

$$P \longleftrightarrow F \quad (一対一対応)$$

$\because$ Hopfの拡張定理

Lem



P({a}) ≠ 0と同値（チェックせよ）

$$\lim_{x \to a} F(x) < F(a)$$

が成り立つとき、「点 a でジャンプがある」と言う。
ジャンプがある点は高々可算個である。 //

(Proof)

$h(a) = P(\{a\})$ とする。
$A = \{a \in \mathbb{R} \mid h(a) > 0\}$ とする。
$A_n = \{a \in \mathbb{R} \mid h(a) \geqq \frac{1}{n}\}$ とおくと、
$A = \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n$ である。

ここで $|A_n| \leqq n$ はすぐにわかるので、A は高々可算。
$\left(\because\ 1 \geqq \underbrace{\sum_{a \in A_n} h(a)}_{P(A_n)} \geqq |A_n| \cdot \frac{1}{n} \to |A_n| \leqq n\right)$ //

Def

${}^{\forall} x \in \mathbb{R}$ に対し、

$$F(x) = \int_{-\infty}^{x} f(t)\, dt$$

なる $f : \mathbb{R} \to \mathbb{R}$ が存在するとき、
f を F の確率密度関数と言う。

このとき、F は絶対連続であると言う。 //

Ex. 正規分布、一様分布、ガンマ分布、指数分布

（ポアソン分布、二項分布は絶対連続ではない）

Radon-Nikodymの定理
※ ルベーグ測度 μ に対し、$\mu(E)=0$ をみたす任意の $E \in \mathcal{B}(\mathbb{R})$ について
$P(E) = 0$ となるなら、P（と対応する F）は絶対連続。

○ 多次元空間上の確率測度

Def

$(\mathbb{R}^n, \mathcal{B}(\mathbb{R}^n))$ 上の確率測度 P に対し

$$F(x_1, x_2, \dots, x_n) := P\left((-\infty, x_1] \times (-\infty, x_2] \times \cdots \times (-\infty, x_n]\right)$$
$$= P\left(\{\omega \in \mathbb{R}^n \mid \omega_i \leq x_i \ (i=1,\dots,n)\}\right)$$

を(同時確率)分布関数と言う

//

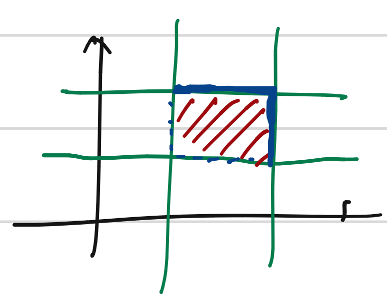
- $P\left((a_1, b_1] \times (-\infty, b_2] \times \cdots \times (-\infty, b_n]\right)$

$$= F(b_1, b_2, \dots, b_n) - F(a_1, b_2, \dots, b_n)$$

- $P\left((a_1, b_1] \times (a_2, b_2] \times \cdots \times (a_n, b_n]\right)$

$$= \sum_{i_1=0}^{1} \sum_{i_2=0}^{1} \cdots \sum_{i_n=0}^{1} (-1)^{i_1 + \cdots + i_n} F(x_{1,i_1}, \dots, x_{n,i_n})$$

ただし $x_{i,0} = b_i$, $x_{i,1} = a_i$ とする.



Lem (分布関数の性質)

(1) F は単調非減少 $\left(x_i \leq y_i \ (\forall i=1,\dots,n) \Rightarrow F(x) \leq F(y)\right)$

(2) F は右上連続

すなわち $x_i \searrow y_i \ (i=1,\dots,n)$ なら

$$F(x) \longrightarrow F(y)$$

(3) $\displaystyle\lim_{\substack{x_j \to -\infty \\ (x_i:\text{fix } (i \neq j))}} F(x_1, \dots, x_j, \dots, x_n) = 0$, $\displaystyle\lim_{x \to (+\infty, \dots, +\infty)} F(x) = 1$

//

Def

$\forall (x_1, \ldots, x_n) \in \mathbb{R}^n$ に対して.

$$F(x_1, \ldots, x_n) = \int_{-\infty}^{x_1} \cdots \int_{-\infty}^{x_n} f(t_1, \ldots, t_n) \, dt_1 \cdots dt_n$$

が成り立つ $f : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ が存在する時.
f を F の同時確率密度関数と言う

//