

一般の確率空間

確率・統計 - 第2講

村田 昇

前回のおさらい

- 有限試行の確率空間
 - 確率論の基本用語: 試行, 標本点, 標本空間, 事象
 - 事象は標本空間の部分集合
 - 事象の演算は集合の演算と等価
 - 確率測度の基本的な性質 (正值性, 加法性, 全確率)
 - 確率空間は標本空間, 事象の集合, 確率測度の3つ組

有理数の可算性

可算集合

- 定義
 - 集合の全ての要素に自然数で順番に番号が与えられることを**可算 (可付番) (enumerable, countable)** という.
- 自明な可算集合の例
 - 要素が有限個の集合
 - 自然数

有理数の可算性

- 区間 $(0, 1)$ に含まれる全ての有理数は可算
 - 有理数と自然数に1対1の対応があることを示せばよい

分子 \ 分母	2	3	4	5	6	...
1	1/2	1/3	1/4	1/5	1/6	...
2		2/3	2/4	2/5	2/6	...
3			3/4	3/5	3/6	...
4				4/5	4/6	...
5					5/6	...
⋮						...

- 対応づけ出来そうだが規則の記述は難しそう

Bernstein の定理

- 1対1の対応が存在することを示す代わりに, A と B の部分集合, および A の部分集合と B の間にそれぞれ1対1の対応が存在することを示せばよい.

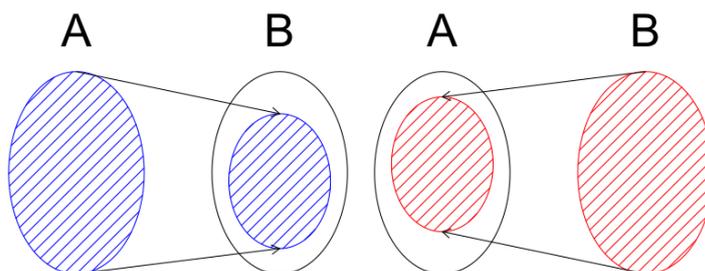


図 1: Bernstein の定理

有理数の可算性 (再考)

- Bernstein の定理を用いた場合
 - 全ての自然数 n から有理数の部分集合 $1/q$ への 1 対 1 対応

$$n \mapsto \frac{1}{q} = \frac{1}{n+1}$$

(有理数としては $1/q$ の形しか用いない)

- 全ての有理数 p/q から自然数 n の部分集合への 1 対 1 対応

$$\frac{p}{q} \mapsto n = 2^p \times 3^q$$

(自然数としては 2 と 3 の倍数しか用いない)

演習

練習問題

- 整数が可算であることを示せ.
- 自然数の組 (m, n) が可算であるかどうか論じよ.
- 1 以上の有理数が可算であるかどうか論じよ.

無理数の非可算性

非可算集合

- 定義
 - 可算でないことを**非可算 (unenumerable, uncountable)** という. (不可算と書かれている場合もある)
- 非可算集合の例
 - 区間 $(0, 1)$ に含まれる無理数
 - 実数全体

演習

練習問題

- 以下の集合の濃度を答えなさい。
 - 区間 $(0, 1)$ に含まれる有理数
 - 区間 $(0, 1)$ に含まれる無理数
 - 実数 \mathbb{R} (区間 $(-\infty, \infty)$)
 - 2つの実数の組 $(x, y) \in \mathbb{R}^2$
 - 2次元空間で xy 座標がともに整数となる点の集合
 - 表が出るまでコインを投げ続ける試行の標本空間

一般の確率測度

可測集合

可測集合 (measurable set) 確率測度 P で確率の値を測ることができる集合
(標本点の集合の中で事象として考えてよいもの)

可測 (measurable) “集合 A が可測” とは集合 A を確率測度 P で測ることができること

集合族

- 確率測度 P で確率の値を測ることができる対象全体 (関数 P の **定義域**) を \mathcal{F} と書く
- 定義域 \mathcal{F} は可測な事象 (標本空間の部分集合) $A \subset \Omega$ の集まり
- このような “集合の集合” を **集合族 (family of sets)** という

σ -加法族

- 定義
以下の $(\sigma.1)$ - $(\sigma.3)$ の3つの条件を満たす集合族を **σ -加法族 (σ -algebra)** と呼ぶ。

$$(\sigma.1) \quad \Omega \in \mathcal{F}$$

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

$$(\sigma.3) \quad A_n \in \mathcal{F}, (n = 1, 2, \dots) \Rightarrow \bigcup_{n=1}^{\infty} A_n \in \mathcal{F}$$

- $(\sigma.1)$ - $(\sigma.3)$ は定義域 \mathcal{F} の満たすべき条件でもある

条件の意味

$(\sigma.1)$ 標本空間 (全事象) は可測である (P で測ることができる)

$(\sigma.2)$ ある事象が可測なら, その余事象も可測である

$(\sigma.3)$ 可測集合の可算 (自然数で番号付けできる) 無限和も可測である

確率測度

- 定義

集合関数 P は条件 (P.1), (P.2) を満たすとき **測度 (measure)** と呼ばれ, さらに (P.3) まで満たすとき **確率測度 (probability measure)** と呼ばれる. また $P(A)$ を A の **測度** という.

$$(P.1) \quad P(A) \geq 0, A \in \mathcal{F}$$

$$(P.2) \quad P\left(\sum_{n=1}^{\infty} A_n\right) = \sum_{n=1}^{\infty} P(A_n), A_n \in \mathcal{F}$$

$$(P.3) \quad P(\Omega) = 1$$

- (P.2) を σ -加法性 (σ -additivity) という

確率空間

- 定義

標本空間 Ω と確率測度 P , および P の定義域である σ -加法族 \mathcal{F} の組 (Ω, \mathcal{F}, P) を **確率空間 (probability space)** という.

Lebesgue 測度

ルーレット回しの確率測度

- 区間 $(0, 1]$ からの無作為抽出

試行 T を “区間 $(0, 1]$ から無作為に一点抜き出すこと” とする. このとき標本空間は

$$\Omega = (0, 1]$$

であり無限試行となる. 確率測度は事象 A が区間 $[a, b], (a, b), [a, b)$ または $(a, b]$ といった簡単な集合であれば

$$P(A) = |A| = b - a, (|A| \text{ は区間の長さを表す})$$

とすればよい.

確率測度の定義域

- 確率測度 P の定義域 \mathcal{F} は集合演算で作られる
- **可算個** の区間を組み合わせで作られる集合

$$\mathcal{F} = \{\text{可算個の任意の区間の和, 差, 交, 余集合から作られる集合}\}$$

- 集合の測度 (確率) は (P.2) の性質より排反な区間の長さの和から計算できる

Lebesgue 測度

- 定義

“区間 $(0, 1]$ から無作為に一点抜き出す” 試行 T によって考えられる確率測度 P を $(0, 1]$ 上の **Lebesgue 測度 (Lebesgue measure)** という. また Lebesgue 測度の定義域となる σ -加法族を \mathbb{R} の **Borel 集合族 (Borel field)** という.

- Lebesgue 測度は μ で表されることが多い
- 厳密な定義については Lebesgue 積分の本を参照

Lebesgue 測度の計算

- 一点が抜き出される確率

Lebesgue 測度において、 $P\{a\}$ (一点 a が抜き出される確率) は 0 となる。
例えば $\{1, 1/2, 1/3, \dots\}$ という可算集合を考えると、

$$P\left\{\frac{1}{n}\right\} \geq \varepsilon > 0 \Rightarrow P\left(\left\{1, \frac{1}{2}, \frac{1}{3}, \dots\right\}\right) = \sum_{n=1}^{\infty} P\left\{\frac{1}{n}\right\} \rightarrow \infty$$

となり矛盾が生じる。

- 抜き出した点が有理数である確率

$$\mathbb{R}_{(0,1]} = \{\text{区間 } (0, 1] \text{ 上の実数全体}\} (= \Omega)$$

$$\mathbb{Q}_{(0,1]} = \{\text{区間 } (0, 1] \text{ 上の有理数全体}\}$$

と書くことにする。有理数は **可算** であるからその要素に番号が付けられ、

$$\mathbb{Q}_{(0,1]} = \{q_1, q_2, q_3, \dots, q_n, \dots\}$$

と書けるので、(P.2) の性質により計算できる。

$$\begin{aligned} P(\mathbb{Q}_{(0,1]}) &= P(\{q_1, q_2, q_3, \dots, q_n, \dots\}) \\ &= P\{q_1\} + P\{q_2\} + P\{q_3\} + \dots + P\{q_n\} + \dots \\ &= 0 + 0 + 0 + \dots + 0 + \dots = 0 \end{aligned}$$

- 抜き出した点が無理数である確率

$$\{\text{区間 } (0, 1] \text{ 上の無理数全体}\} = \mathbb{R}_{(0,1]} - \mathbb{Q}_{(0,1]}$$

を用いて求められる。

$$P(\mathbb{R}_{(0,1]} - \mathbb{Q}_{(0,1]}) = P(\mathbb{R}_{(0,1]}) - P(\mathbb{Q}_{(0,1]}) = 1 - 0 = 1$$

無理数全体は **可算でない** ため有理数のように成分毎の可算無限和では書けず、したがって (P.2) の性質を使って計算することはできない。

- 異なる区間の場合

“区間 $(0, 5]$ から無作為に一点抜き出す” 試行を考えたとき、その標本空間は $\Omega = (0, 5]$ となる。この試行の確率測度は Lebesgue 測度 μ を定数倍 (正規化) し、

$$P(A) = \frac{\mu(A)}{\mu(\Omega)} = \frac{\mu(A)}{5}, A \in \mathcal{F}$$

とすることによって構成できる。

零集合

- 定義

空集合でない集合 A でその事象が起こる確率が $P(A) = 0$ となるものがある。こうした集合を **零集合 (null set)** と呼ぶ。

- 以下は等しくないことに注意 (有理数と無理数の例)

- 事象 A の確率が 0 である
- 事象 A に含まれる標本点が全く起こらない

“ほとんど確実”

- 確率での特殊な言い回し

事象 $A = \{\omega | \alpha(\omega)\}$ の確率が 1 であるとき, “ほとんど確実に (almost surely)” あるいは “条件 $\alpha(\omega)$ が確率 1 で成り立つ” といい, 以下のように書く.

$\alpha(\omega)$ a.s.

- 別の表現
 - 事象 A の余事象 A^c は零集合
 - 条件 α は成り立たないこともあるが, その確率は 0

演習

練習問題

- Buffon の針 (Buffon's needle) の問題を考えよ

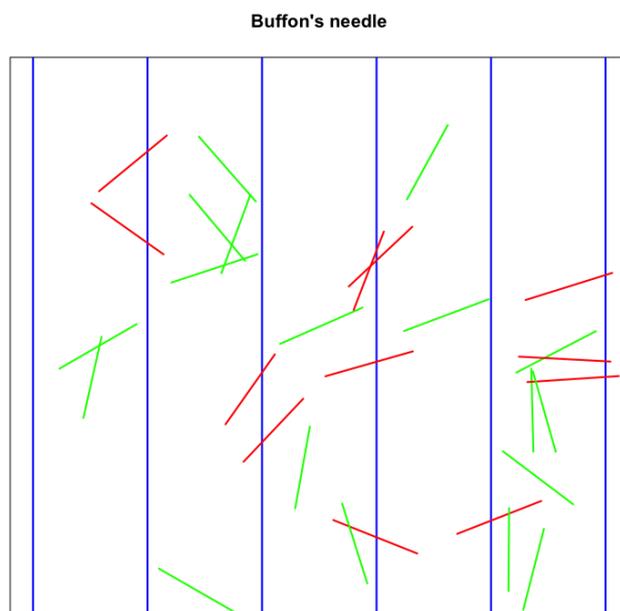


図 2: Buffon の針

2次元平面上に等間隔 d で平行線が引いてある. 長さ l の針をこの平面上にランダムに落としたとき, 平行線と交わる確率を求めよ. ただし $l < d$ とする.

今回のまとめ

- 一般の確率空間
 - 有限集合と無限集合
 - 集合の濃度 (無限集合は更に分類される)
 - * 可算集合: 自然数, 整数, 有理数

- * 連続集合：無理数，実数
- 一般の確率測度と σ -加法性の関係
- Lebesgue 測度と Borel 集合族 (応用上重要な概念)
- “ほとんど確実に成り立つ”