

測度論的確率論 2018 S1S2

Homework 5

経済学研究科現代経済コース修士1年 / 池上 慧 (29186009) / sybaster.x@gmail.com

May 19, 2018

1 Ex 4.12

1.1 (a)

$\{A_n\} \in \mathcal{A}, n = 1, 2, \dots$ を排反にとってくる。この時、

$$\nu\left(\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n\right) = \int_{\bigcup_{n=1}^{\infty} A_n} f d\mu = \int f(1_{A_1} + 1_{A_2} + \dots) d\mu = \int \lim_{N \rightarrow \infty} f \sum_{n=1}^N 1_{A_n} d\mu$$

f が可測関数であり、指示関数も可測関数であることから Corollary 4.1 より

$$\int \lim_{N \rightarrow \infty} f \sum_{n=1}^N 1_{A_n} d\mu = \lim_{N \rightarrow \infty} \sum_{n=1}^N \int f 1_{A_n} d\mu = \sum_{n=1}^{\infty} \nu(A_n)$$

であるので確かに ν は測度となる。 $(\phi$ については後で書く。)

1.2 (b)

簡単な関数から順番に示す。まず、 $g = 1_B$ のような指示関数の場合は、

$$\int g d\nu = \int 1_B d\nu = \nu(B)$$

は必ず定義できる。この時、 ν の定義より以下が成立し、確かに値は同じになる。

$$\int g f d\mu = \int 1_B f d\mu = \int_B f d\mu = \nu(B)$$

次に $g = \sum_{i=1}^m g_i 1_{B_i}, g_i \geq 0, \{B_1, \dots, B_m\} \in \mathcal{A}$ で排反とかけられる simple function の場合を考える。この時、

$$\int g d\mu = \sum_{i=1}^m g_i \int 1_{B_i} d\mu = \sum_{i=1}^m g_i \int 1_{B_i} f d\mu = \int \left(\sum_{i=1}^m g_i 1_{B_i} \right) f d\mu = \int g f d\mu$$

が成立する。ただし二つ目の等号は指示関数のケースの結果より得られる。さらに非負関数 g について考えると、lemma 4.2 より $g_n \uparrow g$ となる非負単関数の列が必ず存在するので、

$$\int g d\nu = \lim_{n \rightarrow \infty} \int g_n d\nu = \lim_{n \rightarrow \infty} \int g_n f d\mu = \int \lim_{n \rightarrow \infty} g_n f d\mu = \int g f d\mu$$

が成立する。ここで一つ目と三つ目の等号は MCT より成立し、二つ目の等号は非負単関数のケースの結果より得られる。最後に一般の可測関数 $g: X \rightarrow \mathbb{R}$ について題意を示す。非負関数のケースより、以下の等号が成立する。

$$\int g d\nu \equiv \int g^+ d\nu - \int g^- d\nu = \int g^+ f d\mu - \int g^- f d\mu \equiv \int g f d\mu$$

どちらかの項が有限の時、上の積分は定義できる。確かにどちらかの積分が定義できればもう片方もそれに対応する項が有限となるのでもう片方の積分も定義できていることが確認された。

2 Ex 4.13

$x \in [0, n]$ で $e^{-x} \geq \left(1 - \frac{x}{n}\right)^n$ を示す。どちらも正なので対数をとって、 $-x \geq n \log \left(1 - \frac{x}{n}\right)$ を示す。

$$n \log \left(1 - \frac{x}{n}\right) = n \left\{ -\frac{x}{n} - \frac{1}{2} \frac{x^2}{n^2} - \frac{1}{3} \frac{x^3}{n^3} - \cdots \right\} = -x - \left(\frac{1}{2} \frac{x^2}{n^2} + \frac{1}{3} \frac{x^3}{n^3} + \cdots \right)$$

であり、最終項は $x \in [0, n]$ で正なので確かに $e^{-x} \geq \left(1 - \frac{x}{n}\right)^n$ である。これより、 $\left| \left(1 - \frac{x}{n}\right)^n 1_{[0, n]} \right| \leq e^{-x}$ である。また、指数関数の定義より $\lim_{n \rightarrow \infty} \left(1 - \frac{x}{n}\right)^n 1_{[0, n]} = e^{-x}$ であるので、優収束定理より以下が成立する。

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^n \left(1 - \frac{x}{n}\right)^n dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^\infty \left(1 - \frac{x}{n}\right)^n 1_{[0, n]} dx = \int_0^\infty \lim_{n \rightarrow \infty} \left(1 - \frac{x}{n}\right)^n 1_{[0, n]} dx = \int_0^\infty e^{-x} dx = 1$$

3 Ex 4.14

以下のような関数列を考える。

$$f_n(x) = \begin{cases} \frac{1}{x} 1_{[1, \infty)} & n = 1 \\ \frac{1}{nx} 1_{[1, n)} & \text{otherwise} \end{cases}$$

この時、

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\mathbb{R}} f_n(x) dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \int_1^\infty \frac{1}{nx} 1_{[1, n]} dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \int_1^n \frac{1}{x} dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{\log n}{n} = 0$$

であり、また任意の $x \in \mathbb{R}$ に対して十分大きな N が存在して、 $n \geq N$ であれば任意の $\epsilon > 0$ よりも $\frac{1}{nx}$ を小さくできるので 0 に各点収束することもわかる。しかし、全ての n について上の関数列の絶対値を抑えるためには $[1, \infty)]$ の範囲で $\frac{1}{x}$ よりも大きくないといけない。ここで $\int_1^\infty \frac{1}{x} dx = \lim_{n \rightarrow \infty} \log n = \infty$ であるため、そのような関数の積分は必ず無限に発散するため L^1 に入らないことが確認できた。

4 Ex 4.15

5 Ex 4.21

6 Ex 4.22

7 Ex 5.3

8 Ex 5.4

9 Ex 5.5

10 Ex 5.6