測度論的確率論 2018 S1S2
Homework 6

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 25, 2018

1 Ex6.3

F のサポートを以下で書くことにする。

$$S_F = \{x \in \mathbb{R} \mid \forall \epsilon > 0,\ F(x+\epsilon) - F(x-\epsilon) > 0\}$$

閉集合の定義より、$\mathbb{R} \setminus S_F$ が開集合であることを示せばよい。任意に $x \in \mathbb{R} \setminus S_F$ を取る時、F が非減少関数であることから、

$$\exists \epsilon > 0 \text{ s.t. } F(x+\epsilon) - F(x-\epsilon) = 0 \tag{1}$$

である。ここで、必ず $\epsilon > \eta > 0$ であるような η が存在し、そのような η について以下が成立する。

$$\begin{cases} F(x+\epsilon) \geq F(x+\eta) \\ F(x-\eta) \geq F(x-\epsilon) \end{cases}$$

(1) より、$F(x+\eta) - F(x-\eta) = 0$ であるので $(x-\eta, x+\eta) \subset \mathbb{R} \setminus S_F$ である。よって定義より $\mathbb{R} \setminus S_F$ は開集合であることが確認できたので題意は示された。

2 Ex6.8

3 Ex6.10

4 Ex6.12

5 Ex6.14

$$E[X] = E\left[X1_{\{X \leq \theta E[X]\}}\right] + E\left[X1_{\{X > \theta E[X]\}}\right]$$

両辺二乗して、第二項にヘルダーの不等式を用いて以下を得る。

$$(E[X])^2 \leq E\left[X1_{\{X \leq \theta E[X]\}}\right]^2 + 2E\left[X1_{\{X \leq \theta E[X]\}}\right] E\left[X1_{\{X > \theta E[X]\}}\right] + E[X^2] P\left(X > \theta E[X]\right)$$

これを整理して以下を得る。

$$P\left(X > \theta E[X]\right) \geq \frac{\left(E\left[X1_{\{X \leq \theta E[X]\}}\right] - E[X]\right)^2}{E[X^2]}$$

従って、題意を得るためには以下が成立していれば良い。

$$\left(E\left[X1_{\{X \leq \theta E[X]\}}\right] - E[X]\right)^2 \geq \left(E[X] - \theta E[X]\right)^2$$

上から打ち切って期待値を撮っているため、$E\left[X1_{\{X \leq \theta E[X]\}}\right] < E[X$ であるので、左辺の中身は負である。一方で、$\theta \in [0,1]$ であるので右辺の中身は正である。これより、以下を示せばよい。

$$E[X] - E\left[X1_{\{X \leq \theta E[X]\}}\right] \geq E[X] - \theta E[X]$$

ここで、$\theta E[X]$ よりも小さい値についてしか期待値を取れないので、$E\left[X1_{\{X \leq \theta E[X]\}}\right] \leq \theta E[X]$ であることから上は確かに成立する。よって題意は示された。

6 Ex6.15

6.1 (a)

$p > q > 0$ とする。この時、$f(x) = -x^{\frac{q}{p}}$ は凸関数である。従って Jensen の不等式より、

$$E\left[-\left(|X|^p\right)^{\frac{q}{p}}\right] \geq -\left(E\left[|X|^p\right]\right)^{\frac{q}{p}}$$

$$\Leftrightarrow E[(|X|^p)^{\frac{q}{p}}] \leq (E[|X|^p])^{\frac{q}{p}}$$

$$\Leftrightarrow\ (E[|X|^q])^{\frac{1}{q}} \leq (E[|X|^p])^{\frac{1}{p}}$$

6.2 (b)

$\frac{r-q}{r-p} + \frac{q-p}{r-p} = 1$ であるので、ヘルダーの不等式を用いて以下を得る。

$$(E[|X|^p])^{\frac{r-q}{r-p}}\,(E[|X|^r])^{\frac{q-p}{r-p}} = \left(E\left[\left(|X|^{p\frac{r-q}{r-p}}\right)^{\frac{r-p}{r-q}}\right]\right)^{\frac{r-q}{r-p}}\left(E\left[\left(|X|^{r\frac{q-p}{r-p}}\right)^{\frac{r-p}{q-p}}\right]\right)^{\frac{q-p}{r-p}} \geq E\left[|X|^{\frac{p(r-q)+r(q-p)}{r-p}}\right] = E[|X|^q]$$

よって題意は示された。