

Adaptive procedure under general conditions

福岡大 理 渡辺正文 (Masafumi Watanabe)

§1. 序

不十分な先験情報のもとでの最適化問題の解を求める方法の一つとして“適応”とか“学習”の考え方がある。確率近似法はその中で確率的な手法の代表的なものとして研究されている。始めは統計的推定の一問題として与えられた (H. Robbins and S. Monro : A stochastic approximation method. Ann. Math. Statist. 22, 1951) がその後逐次的な確率的アルゴリズムとして適応及び学習の面でその有効性が注目された。また、現在はそれらの応用面を考察しながら確率近似法を含むより一般的な逐次的な確率アルゴリズムの研究がなされている。この報告では基本的な Robbins-Monro 型の確率的アルゴリズムの収束について考察する。

確率近似法の収束定理を応用しようとするとき、多くの問題においては観測列 (利用出来る $n.v.m.$ 列) は独立であるこ

とが要求される。従属の場合にも適用出来る収束定理の研究は最近になり研究されている(文献 [1]~[10])。最初は応用上重要な線形な場合に行き与えられ([2]), 一般の場合へと拡張されている([1], [4], [5], [8], [9] etc.)。しかし, 独立の場合に比べると条件は限定されたもので, 一般的なそのとはなっていない。従来の確率近似法の条件に観測列の従属性の条件を加えるだけではうまくいかない。

観測列に対する仮定は以下のタイプが考えられる。

- A. 独立性, マルチンゲール性 従来の確率近似法
- B. mixing 条件, weak dependent 性 [1], [6], [7], [9], [10]
- C. summability (和の収束性) } [2], [3], [8], [9]
- D. stability, 大数の法則, エルゴード性 }
- E. A ~ D より一般的な仮定 [4], [6]

従来の確率近似法は A のタイプのものとで考えられている。従属性の仮定として B ~ E と考える。一般にモーメントに関する適当な条件のもとで, $B \Rightarrow C \Rightarrow D$ が成立する。確率論的な面より考察すると D のタイプが妥当と思われるが, この報告では D より若干一般的な条件 (E のタイプと考えられる) のもとでの収束定理を与える。さらに, C のタイプでの収束定理もあわせて考察する。また考える収束のタイプは a.s. 収束 (確率 1) である。a.s. 収束の場合は, 条件 C ~ E のタイ

プロットとしては本質的に deterministic な議論となり，確率的な手法は用いられない．確率的な考察は $C \sim E$ を導く時に必要となる．

平均収束に関しては文献 [1], [7], [9], [10] の中で考察されている．これらにおいては従属性の条件はいずれも B のタイプである． C 以下の条件で考察するのがこれからの問題と思われるが，モーメントの評価を直接必要とするためやや困難である．

この報告における "general conditions" の意味は従属性の条件 $C \sim E$ と回帰関数（未知関数）に関する一般性を意味する．

§2. Robbins - Monro stochastic approximation

$(\Omega, \mathcal{A}, P)$: 確率空間．以下，考える $\mathcal{R}, \mathcal{V}$ は全てこの空間上で定義されているものとする．

H : 可分な実 Hilbert 空間（観測空間）

内積を $\langle \cdot, \cdot \rangle$, ノルムを $\|\cdot\|$ で表す．

$M(x) : H \rightarrow H$ Borel measurable transformation

$Y_n(x)$, $x \in H$, $n=1, 2, \dots$: H の値をとる x をパラメータとする random elements (観測)

特に, $Y_n(x) = M(x) + Z_n(x)$, $x \in H$, $n=1, 2, \dots$ と表せるとする．

ここで, $Z_n(x)$ は H の値をとる x をパラメータとする random

element (観測誤差)

R-M procedure :

方程式 $M(x) = 0$ の解 $x = \theta$ を求める手法は以下で与え
る,

$$\begin{cases} X_1 = H \text{ の任意の要素} \\ X_{n+1} = X_n - a_n Y_n(X_n) = X_n - a_n \{ M(X_n) + Z_n(X_n) \}, \quad n=1, 2, \dots \end{cases}$$

ここで $\{a_n\}$ は非負実数列.

[1], [9] においては $H = R^m$ の場合, $Z_n(x) = \sum_{j=1}^N m_{j,n}(x) V_j(n)$ と展開出来る場合を考慮している, ただし, $\{m_{j,n}(x)\}$ は non-random で $\{V_j(n)\}$ の mixing-条件 (タイプ B) のもとで procedure の a.s. 及び平均収束を考察している. [9] においては stability ($a_n \delta_n^{-1} \|\sum_{k=1}^n V_j(k)\| \rightarrow 0$ as $n \rightarrow \infty$, $j=1, 2, \dots, N$; タイプ D) のもとで a.s. 収束を示した. また, $M(x)$ の条件は最も一般的な条件を仮定している.

[2], [3] では $M(x) = Ax + B$, $Y_n(x) = A_n x + B_n$ の仮定のもとで

$$\lim_{n \rightarrow \infty} n^{-1} \sum_{j=1}^n A_j = A, \quad \lim_{n \rightarrow \infty} n^{-1} \sum_{j=1}^n B_j = B$$

の場合 (タイプ D) を考察している.

[4], [8] では $H = R^m$ の時, $\sup_n \|X_n\| < \infty$ (a.s.), $M(x)$ は連続という仮定のもとで E のタイプ (特に, [8] では D のタイプ) の条件のもとで, a.s. 収束を考察している. また, [6] では

[2], [3] と同じ線型の場合, $\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{j=1}^n a_j \prod_{k=j+1}^n (1-a_k) A_j = A$,

$\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{j=1}^n a_j \prod_{k=j+1}^n (1-a_k) B_j = B$ (タイプ E) の仮定のもとで, a.s.

収束を考察している。

この報告では $\sup_n \|X_n\| < \infty$ (a.s.) 及び $M(x)$ の連続性は仮定しない。また、収束性の条件は C (定理 A), E (定理 B) で与える。またさらに、収束は a.s. 収束のみを考える。

§3. 基本定理

この章では次章の主結果と導く基本定理を与える。

基本定理. 以下の条件 (i), (ii), (iii) を仮定する。

(i) $a_n > 0$ ($n=1, 2, \dots$), $\lim_{n \rightarrow \infty} a_n = 0$, $\sum_{n=1}^{\infty} a_n = \infty$,

$$\sup_n |a_n - a_{n+1}| < \infty$$

(ii) $v_n \geq 0$ ($n=1, 2, \dots$), $\sum_{n=1}^{\infty} v_n < \infty$

(iii) $\{w_n\}$ は実数列で, $\{x_n\}$ は 非負実数列 で

$$\underline{x_{n+1} \leq (1 - a_n + v_n) x_n + w_n, \quad n=1, 2, \dots}$$

この時, 次の事が成立する。

[I] $\forall T > 0, \exists \omega(T) > 0$;

$$\sup_n \max_{n \leq k < n(n, T)} \left| \sum_{j=n}^k w_j \right| \leq \omega(T),$$

ここで, $\underline{n(n, T) = \max \{k \mid \sum_{j=n}^k a_j \leq T\}}$ (3.1)

$\Rightarrow \exists T_0 > 0, \exists W_0 > 0$ (W_0 は T_0 に関せず) ;

$$\sup_n x_n \leq \{\omega(T_0) + 1\} W_0 \quad \dots \dots (3.2)$$

(II) $\forall T > 0$ に対し

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \max_{n \leq k < m(n, T)} \left| \sum_{j=n}^k w_j \right| = 0$$

$$\Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} X_n = 0 \quad \dots \dots (3.3)$$

証明) N と $a_n \leq 1/2$ ($n \geq N$) と T_0 の正整数とする.

$$1 - a_j + v_j = (1 - a_j) \{ 1 + (1 - a_j)^{-1} v_j \} \leq (1 - a_j) (1 + 2v_j), \quad j \geq N$$

$$A(m, n) \equiv \begin{cases} \prod_{j=m}^n (1 - a_j) (1 + 2v_j) & \text{if } n \geq m \\ 1 & \text{if } n = m-1 \end{cases}$$

$$\text{仮定 (ii) より } 1 \leq \prod_{j=m}^{\infty} (1 + 2v_j) \leq \prod_{j=1}^{\infty} (1 + 2v_j) \equiv \bar{v} < \infty.$$

従って

$$A(m, n) \leq \bar{v} \exp\left(-\sum_{j=m}^n a_j\right), \quad N \leq m \leq n \quad \dots \dots (3.4)$$

$T_0 > 0$ を次の様にとる,

$$T_0 \geq 2, \quad \bar{v} / \exp(-T_0/2) \leq 1/2$$

$$m(n, T_0) \text{ の定義 (3.1) より } T_0 \geq \sum_{j=n}^{m(n, T_0)-1} a_j > T_0/2 \quad (n \geq N)$$

$$\text{従って } A(n, m(n, T_0)-1) \leq \bar{v} \exp(-T_0/2) \leq 1/2 \quad (n \geq N)$$

次に, 以下の補題が成立することとに注意する.

[補題]

$$\sup_n \max_{n \leq k < m(n, T_0)} \left| \sum_{j=n}^k w_j \right| \leq \omega(T_0)$$

$$\Rightarrow \sup_{n \geq N} \max_{n \leq k < m(n, T_0)} \left| \sum_{j=n}^k w_j A(j+1, k) \right| \leq (1 + \bar{v} \bar{A}_N) \omega(T_0),$$

ここで,

$$\bar{A}_N = \sup_{n \geq N} \left\{ \sum_{j=n}^{\infty} a_j \prod_{k=j+1}^{\infty} (1 - a_k) \right\} < \infty.$$

次に, $\{x_n\}$ の部分列 $\{x_{n_r}\}_{r=0}^{\infty}$ を次の様に定義する.

$$n_0 \equiv N, \quad n_r = m(n_{r-1}, T_0), \quad r=1, 2, \dots$$

このとき,

$$x_{n_0} = x_N$$

$$x_{n_1} \leq A(n_0, n_1-1) x_{n_0} + \left| \sum_{j=n_0}^{n_1-1} w_j A(j+1, n_1-1) \right| \leq x_N + 2(1+\bar{v}\bar{A}_N)\omega(T_0)$$

$$x_{n_2} \leq \frac{1}{2} x_{n_1} + (1+\bar{v}\bar{A}_N)\omega(T_0) \leq x_N + 2(1+\bar{v}\bar{A}_N)\omega(T_0)$$

$\vdots$

$$\text{故に, } \sup_r x_{n_r} \leq x_N + 2(1+\bar{v}\bar{A}_N)\omega(T_0) \quad \dots\dots\dots (3.5)$$

任意の $n \geq N$ に対しては, $\exists r: n_r \leq n < n_{r+1}$, 従って, $\{x_n\}$ の仮定と (3.5) より

$$\begin{aligned} x_n &\leq A(n_r, n-1) x_{n_r} + \max_{n_r \leq k < n_{r+1}} \left| \sum_{j=n_r}^k w_j A(j+1, k) \right| \\ &\leq \bar{v} x_{n_r} + (1+\bar{v}\bar{A}_N)\omega(T_0) \\ &\leq 3\bar{v}(1+\bar{v}\bar{A}_N)(x_N + \omega(T_0)) \end{aligned}$$

故に, $\sup_n x_n \leq \{1+\omega(T_0)\} W_0$, ここで, $W_0 = \max\{3\bar{v}(1+\bar{v}\bar{A}_N), 3\bar{v}(1+\bar{v}\bar{A}_N)\bar{x}_N\}$, $\bar{x}_N = \max\{x_1, x_2, \dots, x_N\}$. 従って, [I]が示された.

次に [II] を示す. $N \in$ [I] の証明と同じものとする. さらに, $0 < \varepsilon < 1/2$ とし, T_1 を次の様にとる,

$$T_1 \geq 2, \quad \bar{v}/\exp(T_1/2) < \varepsilon$$

[I] の証明と同様にして

$$A(n, m(n, T_1)-1) \leq \bar{v} \exp[-T_1/2] < \varepsilon < 1/2 \quad \dots\dots\dots (3.6)$$

が示される。[II] の仮定より, $\exists N_1 = N_1(\varepsilon, T_1) \geq N$;

$$\sup_{n \geq N_1} \max_{n \leq k < m(n, T_1)} \left| \sum_{j=n}^k w_j \right| < \varepsilon$$

が成立する。従って, [I] の補題と同様に, τ

$$\sup_{n \geq N_1} \max_{n \leq k < m(n, T_1)} \left| \sum_{j=n}^k w_j A(j+1, k) \right| \leq \varepsilon (1 + \bar{v} \bar{A}_N) \dots (3.7)$$

が示される。

次に, 部分列 $\{x_{n_r}\}_{r=0}^\infty$ を次のように定義する,

$$n_0 \equiv N_1, \quad n_r = m(n_{r-1}, T_1), \quad r=1, 2, \dots$$

$$\text{すなわち, } N \leq N_1, \quad \sup_n x_n \leq W_1 = \{1 + \omega(T_0)\} W_0, \quad (3.6), (3.7)$$

より $0 < \varepsilon < \frac{1}{2}$ に注意して

$$x_{n_1} \leq \varepsilon (W_1 + 1 + \bar{v} \bar{A}_N) < 2\varepsilon (W_1 + 1 + \bar{v} \bar{A}_N)$$

$$x_{n_2} \leq \frac{1}{2} x_{n_1} + \varepsilon (W_1 + 1 + \bar{v} \bar{A}_N) < 2\varepsilon (W_1 + 1 + \bar{v} \bar{A}_N)$$

⋮

$$x_{n_r} \leq 2\varepsilon (1 + W_1 + \bar{v} \bar{A}_N), \quad r=1, 2, \dots$$

よって, $n \geq N_1$ なる n に対しては, $\exists r \geq 1$: $n_r \leq n < n_{r+1}$ となる

からとて, (3.7) を用いて

$$x_n \leq A(n_r, n) x_{n_r} + \max_{n_r \leq k < n_{r+1}} \left| \sum_{j=k}^n w_j A(j+1, k) \right|$$

$$\leq \bar{v} x_{n_r} + 2\varepsilon (1 + W_1 + \bar{v} \bar{A}_N)$$

$$\leq 3\varepsilon \bar{v} (1 + W_1 + \bar{v} \bar{A}_N), \quad n \geq N_1$$

$$\text{故に, } \lim_{n \rightarrow \infty} x_n \leq 3\varepsilon \bar{v} (1 + W_1 + \bar{v} \bar{A}_N).$$

従って, $x_n \geq 0$ より (3.3) が示される。■

注意. $a_n \downarrow 0$ とし, $w_n = a_n w'_n$ ($n=1, 2, \dots$) とする.

以下の条件を考える,

$$(1) \quad \sum_{n=1}^{\infty} a_n w'_n \quad \text{収束} \quad (917^\circ C)$$

$$(2) \quad \lim_{n \rightarrow \infty} a_n \sum_{j=1}^n w'_j = 0 \quad (917^\circ D)$$

$$(3) \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{j=1}^n a_j \prod_{k=j+1}^n (1-a_k) w'_j = 0 \quad (917^\circ E, [6])$$

$$(4) \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \max_{n \leq k < m(n, T)} \left| \sum_{j=n}^k a_j w'_j \right| = 0 \quad (917^\circ E)$$

この時, 以下の事成立する.

$$(1) \quad \text{ワロキカ-の補題より,} \quad (1) \Rightarrow (2)$$

$$(a_n^{-1} - a_{n+1}^{-1}) \leq K \text{ より,} \quad (2) \Rightarrow (3)$$

さらに, $(3) \Rightarrow (4)$ も示される. 従, Σ

$$(1) \Rightarrow (2) \Rightarrow (3) \Rightarrow (4).$$

ロ) $a_n = n^{-1}$ のときは, $(n-2)e^T \leq m(n, T) \leq ne^T$ とおきこ
とより, $(4) \Rightarrow (2)$. また, $(3) \Leftrightarrow (2)$ は明らか. 従, Σ

$$(2) \Leftrightarrow (3) \Leftrightarrow (4).$$

ハ) $a_n = n^{-1}$ とおきぬ場合は限らず (モ (4) $\Rightarrow$ (2) は成立) なる
例えば, $a_n = n^{-\alpha}$, $w'_n = n^{-\beta}$, $0 < \alpha, \beta$, $\alpha + \beta = 1$. この
とき, 明らかに (1) - (2) は成立する. (しかし,

$$m(n, T) \sim \{ n^{1-\alpha} + (1-\alpha)T \}^{1/\alpha}$$

とおきこ とより

$$\begin{aligned} \sum_{j=n}^{m(n, T)} a_j w'_j &= \sum_{j=n}^{m(n, T)} j^{-1} \sim \log m(n, T) - \log n \\ &= (1-\alpha)^{-1} \log \{ 1 + (1-\alpha)T n^{-\alpha} \} \rightarrow 0 \end{aligned}$$

従って, (4) は成立する.

上の事に注意すると, 条件 (4) はより一般的な条件, タイプ E と考える事が出来る. (しかし, D のタイプ (2)) と本質的には差はないともいえる.

§4. A.s. convergence of R-M procedure

この章では §2 で与えた手法の収束定理を与える. 定理 A は §1 で述べた タイプ C に対応するもので, $M(x)$ に関する条件は最も弱いものを考えられる. 定理 B は $M(x)$ に関する条件は定理 A よりも強く仮定するが, タイプ E に対応するものである.

以下の仮定を与える.

A0: $\equiv$ positive r.v.'s の列 $\{\delta_n\}$;

$$(i) \quad \delta_n \downarrow 0 \quad (\text{a.s.}) \quad , \quad \sup_n \delta_n \delta_{n+1}^{-1} < \infty \quad (\text{a.s.})$$

$$(ii) \quad \sup_n \delta_n \|X_n\| < \infty \quad (\text{a.s.})$$

$$A1: \quad \sum_{n=1}^{\infty} a_n^2 < \infty \quad , \quad \sum_{n=1}^{\infty} a_n = \infty$$

$$A2: \quad \equiv \text{constant } C > 0 \quad ;$$

$$\|M(x)\| \leq C(\|x\| + 1) \quad , \quad x \in H$$

$$A3: \quad \equiv \theta \in H \quad , \quad M(\theta) = 0 \quad ;$$

$$\inf_{\varepsilon < \|x - \theta\| < \varepsilon^{-1}} < M(x), x - \theta > > 0 \quad (0 < \varepsilon < 1)$$

$$A4: \quad \equiv \text{nonnegative r.v.'s の列 } \{\alpha_n\} \quad ;$$

$$(i) \quad \|Z_n(x)\| \leq \alpha_n (\|x\| + 1) \quad , \quad x \in H \quad , \quad n = 1, 2, \dots$$

$$(ii) \quad \sum_{n=1}^{\infty} a_n^2 \alpha_n^2 < \infty \quad (\text{a.s.})$$

A5: $\exists$ positive r.v. δ_0 ;

$$(i) \quad \sup_{n,k} \left\| \sum_{j=n}^k a_j \delta_j^{-3} Z_j(x) \right\| \leq \delta_0 (\|x\| + 1), \quad x \in H$$

$$(ii) \quad \sup_{n,k} \left\| \sum_{j=n}^k a_j \delta_j^{-3} \{Z_j(x) - Z_j(y)\} \right\| \leq \delta_0 \|x - y\|, \quad x, y \in H$$

$$(iii) \quad \sum_{n=1}^{\infty} a_n \delta_n \alpha_n < \infty \quad (\text{a.s.})$$

B0: A0 が成立.

B1: A1 の他に, $\sup_n |a_n^{-1} - a_{n+1}^{-1}| < \infty$ が成立.

B2: A2 が成立.

B3: $\exists \theta \in H, M(\theta) = 0$; $\exists \lambda > 0$

$$\langle M(x), x - \theta \rangle \geq \lambda \|x - \theta\|^2, \quad x \in H$$

B4: A4 が成立

B5: $\forall T > 0, \exists$ positive r.v. δ_T ;

$$(i) \quad \sup_n \max_{n \leq k < m(n,T)} \left\| \sum_{j=n}^k a_j \delta_j^{-3} Z_j(x) \right\| \leq \delta_T (\|x\| + 1), \quad x \in H$$

$$(ii) \quad \sup_n \max_{n \leq k < m(n,T)} \left\| \sum_{j=n}^k a_j \delta_j^{-3} \{Z_j(x) - Z_j(y)\} \right\| \leq \delta_T \|x - y\|, \quad x, y \in H$$

$$(iii) \quad \sup_n \sum_{j=n}^{m(n,T)-1} a_j \delta_j \leq \delta_T \quad (\text{a.s.})$$

注意 仮定 A0 (= B0) は, $\exists$ positive r.v.'s $\{\tau_n\}$;

$$\langle \theta - x, Y_n(x) \rangle \leq \tau_n (\|x\| + 1)$$

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n \delta_n \tau_n < \infty \quad (\text{a.s.})$$

が成立すると, [9] の Lemma 1 を用いて得ることも出来る.

仮定 A に対応して次の定理が成立する.

定理 A. 仮定 $A_0 \sim A_5$ が成立するならば

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \|X_n - \theta\| = 0 \quad (\text{a.s.})$$

略証) アルゴリズムより

$$\begin{aligned} \|X_{n+1} - \theta\|^2 &= \|X_n - \theta\|^2 - 2a_n \langle X_n - \theta, M(X_n) + Z_n \rangle + a_n^2 \|M(X_n) + Z_n\|^2 \\ &\leq (1 + Ka_n^2 + Ka_n^2 \alpha_n^2) \|X_n - \theta\|^2 - 2a_n \langle X_n - \theta, M(X_n) + Z_n \rangle \\ &\quad + Ka_n^2 (\alpha_n^2 + 1), \quad n=1, 2, \dots, \end{aligned}$$

ここで, $Z_n \equiv Z_n(X_n)$, K は正実数. このとき,

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n \langle X_n - \theta, Z_n \rangle \quad \text{converges (a.s.)}$$

が仮定 A_0, A_5 を用いて示され, [9] の定理 1 と同様の方法で結論を得る. ■

仮定 B に対応して次の定理が成立する.

定理 B. 仮定 $B_0 \sim B_5$ が成立するならば

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \|X_n - \theta\| = 0 \quad (\text{a.s.})$$

略証) B_3 より,

$$\begin{aligned} \|X_{n+1} - \theta\|^2 &\leq (1 - 2\lambda a_n + Ka_n^2 + Ka_n^2 \alpha_n^2) \|X_n - \theta\|^2 - 2a_n \langle X_n - \theta, Z_n \rangle \\ &\quad + Ka_n^2 (\alpha_n^2 + 1), \quad n=1, 2, \dots \end{aligned}$$

を得る. また, B_0, B_1, B_4, B_5 を用いて, $\forall T > 0, \equiv \omega_1(T)$;

$$\sup_n \max_{n \leq k < n(nT)} \left| \sum_{j=n}^k a_j \langle X_j - \theta, Z_j \rangle \right| \leq \omega_1(T) \quad (\text{a.s.})$$

を得る. 従って, 与えられた基本定理の [I] より, $\equiv$ positive n.v. W_0 ;

$$\sup_n \|X_n - \theta\| \leq \{\omega(T) + 1\} W_0. \quad \dots\dots (4.1)$$

を得る. B5 (i), (ii) より次の事が成立する, $\exists$ positive n.v.s $\{\tau_n\}$;

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \tau_n = 0 \quad (\text{a.s.})$$

$$(i') \quad \max_{n \leq k < m(n, T)} \left\| \sum_{j=n}^k a_j Z_j(x) \right\| \leq \tau_n (\|x\| + 1), \quad n=1, 2, \dots$$

$$(ii') \quad \max_{n \leq k < m(n, T)} \left\| \sum_{j=n}^k a_j \{Z_j(x) - Z_j(y)\} \right\| \leq \tau_n \|x - y\|, \quad n=1, 2, \dots$$

従, τ , (4.1) と (i'), (ii'), B5 (iii) より, $\forall T > 0$ に対して

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \max_{n \leq k < m(n, T)} \left| \sum_{j=n}^k a_j \langle X_j - \theta, Z_j(X_j) \rangle \right| = 0 \quad (\text{a.s.})$$

が示され, 基本定理の [IV] を用いて結論を得る. $\square$

注意. B0 の代りに, $\sup_n \|X_n\| < \infty$ (a.s.) が成立する場合
は定理 B において, B5 は次の仮定 B5' に置き代えることが出
来る.

B5': $\forall T > 0$, $\exists$ positive n.v.s $\{\tau_n\}$;

$$(i) \quad \max_{n \leq k < m(n, T)} \left\| \sum_{j=n}^k a_j Z_j(x) \right\| \leq \tau_n (\|x\| + 1), \quad x \in H, \quad n=1, 2, \dots$$

$$(ii) \quad \max_{n \leq k < m(n, T)} \left\| \sum_{j=n}^k a_j \{Z_j(x) - Z_j(y)\} \right\| \leq \tau_n \|x - y\|, \quad x, y \in H, \quad n=1, 2, \dots$$

(iii) B5 の (iii) が成立.

$$(iv) \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \tau_n = 0 \quad (\text{a.s.})$$

証明は定理 B の証明の後半部分と同じ手法で, 基本定理の [IV]
を用いて示される.

References

- [1] Borodin, A.N. : A stochastic approximation procedure in the case of weakly dependent observations. *Theory Prob. Appl.* 24, 34 - 52 (1979).
- [2] Fritz, J. : Learning from an ergodic training sequence. In "Limit Theorems of Probability Theory" ; ed. P. Révész. North Holland, 79 - 91 (1974).
- [3] Györfi, L. : Stochastic approximation from ergodic sample for linear regression. *Z. Wahrscheinlichkeitstheorie verw. Geb.* 54, 47 - 55 (1980).
- [4] Kushner, H.J. and Clark D.S. : Stochastic approximation methods for constrained and unconstrained systems. Springer 1978.
- [5] Ljung, L. : Strong convergence of a stochastic approximation algorithms. *Ann. Statist.* 6, 680 - 696 (1978).
- [6] Ljung, L. : Analysis of stochastic gradient algorithms for linear regression problem. *IEEE Information Theory* IT-30, 151 - 160 (1984).

- [7] Eweda, E. and Macchi, O. ; Quadratic mean and almost-sure convergence of unbounded stochastic approximation algorithms with correlated observations. Ann. Institut Henri Poincaré, 19 (1983).
- [8] Metivier, M. and Priouret, P. : Application of a Kushner and Clark lemma to general classes of stochastic algorithms. IEEE Information Theory IT-30, 140-151 (1984).
- [9] Watanabe, M. : A stochastic approximation from dependent observations. Z. Wahrscheinlichkeitstheorie verw. Geb. 62, 279-292 (1983).
- [10] Watanabe, M. : The $2r$ -th mean convergence of adaptive filters with stationary dependent random variables. IEEE Information Theory IT-30, 134-140 (1984).