

# On the Strong Law of Large Numbers for Generalized Pairwise *NQD* Random Sequences\*

Zonggang Deng, Jinyu Zhou, Qianjun Xiao, Yun Ma

Hunan Vocational Institute of Technology, Xiangtan  
Email: 744690180@qq.com

Received: Jun. 18<sup>th</sup>, 2012; revised: Jul. 8<sup>th</sup>, 2012; accepted: Jul. 16<sup>th</sup>, 2012

**Abstract:** This paper mainly studies the generalized pairwise *NQD* random sequences of nonnegative random variables sequences of Kolmogorov strong law of large numbers, and zero mean of the generalized pairwise

*NQD* random sequences under the condition of  $\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \right) < \infty, 0 < p \leq 1$  or

$\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} \right) < \infty, 1 < p \leq 2$  of the strong law of large numbers, the identically dis-

tributed of pairwise *NQD* random sequences of the Kolmogorov strong law of large numbers for a class of generalized to in a wide range of conditions of identically distributed of generalized pairwise *NQD* random sequences of the strong law of large numbers.

**Keywords:** Generalized Pairwise *NQD* Sequences; Strong Law of Large Numbers; Kronecker Lemma; Generalized Three Series Theorem

## 两两广义 *NQD* 列的强大数定律\*

邓总纲, 周金玉, 肖前军, 马云

湖南理工职业技术学院, 湘潭  
Email: 744690180@qq.com

收稿日期: 2012年6月18日; 修回日期: 2012年7月8日; 录用日期: 2012年7月16日

**摘要:** 本文主要研究了两两广义 *NQD* 列关于非负随机变量序列的 Kolmogorov 强大数定律和零均值

的两两广义 *NQD* 列在条件  $\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \right) < \infty, 0 < p \leq 1$  或

$\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} \right) < \infty, 1 < p \leq 2$  下的强大数定律, 把同分布的两两 *NQD* 列的

Kolmogorov 强大数定律推广到了在一类广泛的条件下的同分布的两两广义 *NQD* 列的强大数定律。

**关键词:** 两两广义 *NQD* 列; 强大数定律; Kronecker 引理; 广义三级数定理

### 1. 引言

两两 *NQD* 列是一类相当广泛的随机变量序列, 自从 1966 年由著名统计学家 Lehmann<sup>[1]</sup>提出以来, 关于两

\*基金项目: 湖南省教育厅资助科研项目(两两广义 *NQD* 列的性质 11C0637; 基于图形表示方法和分形理论的生物序列分析及其应用 10C0185)。

两  $NQD$  列极限理论的研究已取得很多成果<sup>[2-8]</sup>。在自定义的两两广义  $NQD$  列的定义下, 已经获得了两两广义  $NQD$  列的基本性质、Kolmogorov 不等式、弱大数定律、 $r$  阶平均收敛性和几乎必然收敛性<sup>[2,9]</sup>。

本文研究了两两广义  $NQD$  列关于非负随机变量序列的 Kolmogorov 强大数定律和零均值的两两广义  $NQD$  列在条件  $\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \right) < \infty$ ,  $0 < p \leq 1$  或  $\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} \right) < \infty$ ,  $1 < p \leq 2$  下的强大数定律。

本文约定: 文中出现的  $c$  总表示正常数, 它在不同的地方可以表示不同的值;  $i, j, k, n$  表示整数,  $R$  是实数集,  $E$  是期望,  $P$  表示概率。

## 2. 定义与引理

定义<sup>[9]</sup> 设  $\{X_n, n \geq 1\}$  是定义在同一概率空间上的随机变量序列, 记  $S_n = \sum_{i=1}^n X_i$  ( $n \geq 1$ )。集合  $A$  的示性函数记为  $I_A$ , 称随机变量  $X$  和  $Y$  是广义的  $NQD$  的, 若对任意的  $x, y \in R$ , 存在常数  $c \geq 1$ , 都有

$$P(X < x, Y < y) \leq cP(X < x)P(Y < y),$$

$$P(X > x, Y > y) \leq cP(X > x)P(Y > y) \quad (c \geq 1).$$

称随机变量序列  $\{X_n, n \geq 1\}$  是两两广义  $NQD$  列, 若对任意  $i \neq j$ ,  $X_i$  与  $X_j$  是广义  $NQD$  的。

称随机变量序列  $\{X_k, k \geq 1\}$  是  $p$  阶 Cesaro 一致可积的 ( $p > 0$ ), 若

$$\limsup_{x \rightarrow \infty} n^{-1} \sum_{n \geq 1} E |X_k|^p I(|X_k| \geq x) = 0$$

下面给出三个引理:

引理 1<sup>[2]</sup> (Kronecker 引理) 设  $\{a_n\}$  和  $\{x_n\}$  是两实数序列,  $0 < a_n \uparrow \infty$ ,  $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{x_n}{a_n}$  收敛, 那么  $\sum_{i=1}^n \frac{x_i}{a_i} \rightarrow 0$ , a.s.

引理 2<sup>[3]</sup> (广义三级数定理) 设  $\{X_n, n \geq 1\}$  是两两广义  $NQD$  列,  $EX_n = 0$ 。对某  $c > 0$ , 记  $X_n^c = -c \cdot I\{X_n < -c\} + X_n \cdot I\{|X_n| \leq c\} + c \cdot I\{X_n > c\}$ , 如果

$$\sum_{n=1}^{\infty} P(|X_n| > c) < \infty \tag{1}$$

$$\sum_{n=1}^{\infty} EX_n^c < \infty \tag{2}$$

$$\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n \text{Var} X_n^c < \infty \tag{3}$$

则 
$$\sum_{n=1}^{\infty} X_n < \infty \quad \text{a.s. 收敛} \tag{4}$$

且条件(1)也是条件(4)的必要条件。

引理 3<sup>[9]</sup> 设随机变量  $X$  和  $Y$  是广义  $NQD$  的, 则

1)  $EXY \leq cEXEY$ ;

2) 如果  $f, g$  同为非降(或非增)函数, 则  $f(X)$  与  $g(Y)$  仍为广义  $NQD$  的。

## 3. 主要结果

定理 1 设  $\{X_n, n \geq 1\}$  是两两广义  $NQD$  列,  $\{g_n(x)\}$  是偶函数序列, 它们在区间  $x > 0$  中取正值、不减, 而且对每一  $n$  满足下列条件之一:

1) 在区间  $x > 0$  中,  $\frac{x}{g_n(x)}$  不减;

2) 在区间  $x > 0$  中,  $\frac{x}{g_n(x)}$  和  $\frac{g_n(x)}{x^2}$  都是不增的, 且  $EX_n = 0$ , 此外  $\{a_n\}$  是常数列, 满足  $0 < a_n \uparrow \infty$  和

$$\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n \frac{Eg_n(X_n)}{g_n(a_n)} < \infty, \text{ 则 } \sum_{k=1}^n \frac{X_k}{a_k} \rightarrow 0, a.s.$$

证明: 由引理 1, 要证  $\sum_{k=1}^n \frac{X_k}{a_k} \rightarrow 0, a.s.$ , 只需证明  $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{X_n}{a_n}$ ,  $a.s$  收敛因为  $\left\{ \frac{X_n}{a_n} \right\}$  仍是两两广义  $NQD$  列, 由引理

2 知只需验证(1)~(3)式成立即可。

其中  $c=1$ , 由  $g_n(x)$  当  $x > 0$  时不减的, 有

$$P\{|X_n| \geq a_n\} = \int_{|X_n| \geq a_n} dp \leq \int_{|X_n| \geq a_n} \frac{g_n(X_n)}{g_n(a_n)} dp = \frac{1}{g_n(a_n)} \int_{|X_n| \geq a_n} g_n(X_n) dp = \frac{Eg_n(X_n)}{g_n(a_n)}$$

由条件知

$$\sum_{n=1}^{\infty} P\{|X_n| \geq a_n\} \leq \sum_{n=1}^{\infty} \frac{Eg_n(X_n)}{g_n(a_n)} \leq \sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n \frac{Eg_n(x_n)}{g_n(a_n)} < \infty$$

假设对某个  $n$ , 函数  $g_n(x)$  满足条件(1), 则在区间  $|x| \leq a_n$  中

$$\frac{|x|}{g_n(x)} \leq \frac{a_n}{g_n(a_n)}$$

$$\frac{x^2}{a_n^2} \leq \frac{g_n^2(x)}{g_n^2(a_n)} \leq \frac{g_n(x)}{g_n(a_n)}$$

对于满足条件(2)的  $g_n(x)$ , 在同一区间中, 由于  $\frac{g_n(x)}{x^2}$  不增, 所以

$$\frac{x^2}{g_n(x)} \leq \frac{a_n^2}{g_n(a_n)}$$

因此, 无论  $g_n(x)$  满足(1)或(2), 都有

$$\frac{x^2}{a_n^2} \leq \frac{g_n(x_n)}{g_n(a_n)}$$

对任意  $n$ , 由  $C_r$  不等式有

$$E(X_n^{a_n})^2 \leq E(a_n^2 I(X_n < -a_n) + X_n^2 I(|X_n| \leq a_n) + a_n^2 I(X_n > a_n))$$

$$\ll E(a_n^2 I(|X_n| > a_n) + X_n^2 I(|X_n| \leq a_n))$$

(“ $\ll$ ”表示通常的大“ $O$ ”), 由于  $g_n(x)$  是偶函数, 在  $(0, \infty)$  不减, 所以

$$Ea_n^2 I(|X_n| > a_n) \leq Ea_n^2 I(|X_n| > a_n) \frac{g_n(X_n)}{g_n(a_n)} \leq \frac{a_n^2}{g_n(a_n)} g_n(X_n)$$

由  $\frac{x^2}{a_n^2} \leq \frac{g_n(x_n)}{g_n(a_n)}$  知  $x^2 \leq \frac{g_n(x_n)}{g_n(a_n)} a_n^2$

$$EX_n^2 I(|X_n| \leq a_n) \leq \int_{|X_n| \leq a_n} X_n^2 dp \leq \frac{a_n^2}{g_n(a_n)} \int_{|X_n| \leq a_n} g_n(X_n) dp \leq \frac{a_n^2}{g_n(a_n)} Eg_n(X_n)$$

所以  $E(X_n^{a_n})^2 \ll \frac{a_n^2}{g_n(a_n)} Eg_n(X_n)$  结合条件得  $\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n \frac{E(X_n^{a_n})^2}{a_n^2} \ll \sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n \frac{Eg_n(X_n)}{g_n(a_n)} < \infty$ 。

另外, 若条件(1)满足, 则

$$\begin{aligned} |EX_n^{a_n}| &= |E(-a_n I(X_n < -a_n) + X_n I(|X_n| \leq a_n) + a_n I(X_n > a_n))| \leq Ea_n I(|X_n| > a_n) + |EX_n I(|X_n| \leq a_n)| \\ &\leq Ea_n \frac{g_n(X_n)}{g_n(a_n)} I(|X_n| > a_n) + \left| \int_{|X_n| \leq a_n} X_n dp \right| \leq \frac{a_n}{g_n(a_n)} Eg_n(X_n) + \frac{a_n}{g_n(a_n)} \int_{|X_n| \leq a_n} g_n(X_n) dp \\ &\leq 2 \frac{a_n}{g_n(a_n)} Eg_n(X_n) \end{aligned}$$

若条件(2)满足, 由  $EX_n = 0, \frac{x}{g_n(x)}$  不增, 得

$$\begin{aligned} |EX_n^{a_n}| &\leq Ea_n I(|X_n| > a_n) + EX_n I(|X_n| \leq a_n) = Ea_n I(|X_n| > a_n) + |EX_n - EX_n I(|X_n| > a_n)| \\ &= Ea_n I(|X_n| > a_n) + |EX_n I(|X_n| > a_n)| \leq \frac{a_n}{g_n(a_n)} Eg_n(X_n) + \frac{a_n}{g_n(a_n)} \int_{|X_n| > a_n} g_n(X_n) dp \\ &\leq 2 \frac{a_n}{g_n(a_n)} Eg_n(X_n) \end{aligned}$$

所以都满足

$$\sum_{n=1}^{\infty} E \frac{X_n^{a_n}}{a_n} \leq 2 \sum_{n=1}^{\infty} \frac{Eg_n(X_n)}{g_n(a_n)} < \infty$$

由引理 2 得  $\sum_{k=1}^n \frac{X_k}{a_k} \rightarrow 0, a.s.$

证毕。

在定理 1 中, 令  $g_n(x) = |x|^p, p > 0$ , 可得到一个重要的推论:

**推论 1** 设  $\{X_n, n \geq 1\}$  是两两广义  $NQD$  列,  $0 < a_n \uparrow \infty$

$$\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n \frac{E|X_n|^p}{a_n^p} < \infty, \quad 0 < p \leq 2$$

且当  $1 < p \leq 2$  时,  $EX_n = 0$ , 则  $\sum_{k=1}^n \frac{X_k}{a_k} \rightarrow 0, a.s.$

**定理 2** 设  $\{X_n, n \geq 1\}$  为零均值的两两广义  $NQD$  列, 若下列条件之一成立:

$$\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \right) < \infty, \quad 0 < p \leq 1 \tag{1}$$

$$\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} \right) < \infty, \quad 1 < p \leq 2 \tag{2}$$

其中  $M > 0, \{a_n\}$  是常数列且满足  $0 < a_n \uparrow \infty$  则  $\sum_{k=1}^n \frac{X_k}{a_k} \rightarrow 0, a.s.$

证明: 当  $0 < p \leq 1$ ,  $|X_n| \geq Ma_n > 0$  时, 有  $\frac{2|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \geq 1$

所以  $P(|X_n| \geq Ma_n) = E(I(|X_n| \geq Ma_n)) \leq E\left(\frac{2|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p}\right)$ ;

所以  $\sum_{n=1}^{\infty} P(|X_n| \geq Ma_n) \leq \sum_{n=1}^{\infty} E\left(\frac{2|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p}\right) \leq \sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n E\left(\frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p}\right) < \infty$ 。

当  $1 < p \leq 2$ ,  $|X_n| \geq Ma_n > 0$  时,

$$1 = \frac{2|X_n|^p}{|X_n|^p + |X_n|^p} \leq \frac{2|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}}$$

$$P(|X_n| \geq Ma_n) = E(I(|X_n| \geq Ma_n)) \leq E\frac{2|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} < \infty$$

从而当(1)或(2)成立时, 有  $\sum_{n=1}^{\infty} P\left(\left|\frac{X_n}{a_n}\right| \geq M\right) < \infty$  成立。

记  $X_n^c = -Ma_n I(X_n < -Ma_n) + X_n I(|X_n| \leq Ma_n) + Ma_n I(X_n > Ma_n)$  由引理 3 知  $\{X_n^c\}$  仍为两两广义  $NQD$  列,

从而  $\left\{\frac{X_n^c}{a_n}\right\}$  也是两两广义  $NQD$  列, 当  $0 < p \leq 1$ ,  $|X_n| \leq Ma_n$  时, 有  $|X_n|^{1-p} \leq |Ma_n|^{1-p}$  所以  $|X_n|^{p-1} \geq |Ma_n|^{p-1}$ 。

因为

$$\begin{aligned} |EX_n I(|X_n| \leq Ma_n)| &\leq |EX_n I(|X_n| \leq Ma_n)| \leq c \cdot E \frac{|X_n|}{1+|X_n|} \leq c \cdot E \frac{|X_n|}{1+\frac{|X_n|^p}{Ma_n^p}} = c \cdot E \frac{|X_n|(Ma_n)^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \\ &\leq c \cdot E \frac{|X_n|(Ma_n)^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \cdot \frac{|X_n|^{p-1}}{|Ma_n|^{p-1}} = c \cdot E \frac{|X_n|^p Ma_n}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \leq c \cdot a_n E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \end{aligned}$$

所以

$$\begin{aligned} |EX_n^c| &\leq E|Ma_n I(|X_n| > Ma_n)| + |EX_n I(|X_n| \leq Ma_n)| \leq ca_n EI(|X_n| > Ma_n) + c \cdot a_n E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \\ &\leq c \cdot a_n E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \end{aligned}$$

当  $1 < p \leq 2$ , 由  $EX_n = 0$  有

$$\begin{aligned} |EX_n^c| &= E|Ma_n I(|X_n| > Ma_n)| + |EX_n I(|X_n| \leq Ma_n)| \leq c \cdot a_n EI(|X_n| > Ma_n) + E|X_n I(|X_n| > Ma_n)| \\ &\leq c \cdot a_n E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} + c \cdot E \frac{|X_n|^p}{(X_n)^{p-1} + |X_n|^{p-1}} \\ &\leq c \cdot a_n E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} + c \cdot E \frac{Ma_n |X_n|^p}{Ma_n (X_n)^{p-1} + (Ma_n)^p} \leq c \cdot a_n E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} \end{aligned}$$

从而当(1)或(2)成立时, 有  $\sum_{n=1}^{\infty} E \frac{X_n^c}{a_n} < \infty$  成立。

最后, 若  $0 < p \leq 2$ , 由  $C_r$  不等式有

$$\begin{aligned} E(X_n^c)^2 &= E(-Ma_n I(X_n < -Ma_n) + X_n I(|X_n| \leq Ma_n) + Ma_n I(X_n > Ma_n))^2 \\ &\leq c \cdot (E(Ma_n)^2 I(|X_n| > Ma_n) + EX_n^2 I(|X_n| \leq Ma_n)) \\ &= c \cdot a_n^2 E I(|X_n| > Ma_n) + c \cdot EX_n^2 I(|X_n| \leq Ma_n) \end{aligned}$$

当  $0 < p \leq 1$ ,  $|X_n| \leq Ma_n$  时

$$EX_n^2 I(|X_n| \leq Ma_n) \leq Ma_n \cdot E|X_n| I(|X_n| \leq Ma_n) \leq c \cdot a_n^2 E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p}$$

又因为

$$a_n^2 E I(|X_n| > Ma_n) \leq c \cdot a_n^2 E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p}$$

所以当(1)成立时有

$$\sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n \cdot E \left( \frac{X_n^c}{a_n} \right)^2 \leq c \cdot \sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n \cdot E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + |X_n|^p} \right) \text{ 成立}$$

当  $1 < p \leq 2$ ,  $|X_n| \leq Ma_n$  时, 有

$$a_n^2 E I(|X_n| > Ma_n) \leq c \cdot a_n^2 E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}}$$

$$\begin{aligned} EX_n^2 I(|X_n| \leq Ma_n) &= |E(|X_n| I(|X_n| \leq Ma_n) \cdot |X_n| I(|X_n| \leq Ma_n))| \leq Ma_n \cdot |E(|X_n| I(|X_n| \leq Ma_n))| \\ &= Ma_n \cdot E|X_n| I(|X_n| > Ma_n) \leq c \cdot a_n^2 E \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} \end{aligned} \text{ 成立。}$$

若(2)式成立时, 有

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{\log^2 n \cdot E(X_n^c)^2}{a_n^2} \leq c \cdot \sum_{n=1}^{\infty} \log^2 n \cdot E \left( \frac{|X_n|^p}{(Ma_n)^p + Ma_n |X_n|^{p-1}} \right) < \infty \text{ 成立。}$$

总之有

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{\log^2 n \cdot E(X_n^c)^2}{a_n^2} < \infty \text{ 成立。}$$

由引理 2 知  $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{X_n}{a_n}$   $a.s$  收敛, 再由引理 1 知

$$\sum_{k=1}^n \frac{X_k}{a_k} \rightarrow 0 \quad a.s$$

证毕。

#### 4. 结语

本文主要研究了两两广义  $NQD$  列的强大数定律, 把同分布的两两  $NQD$  列的 Kolmogorov 强大数定律推广

到了在一类广泛的条件下的不同分布的两两广义  $NQD$  列的强大数定律, 从而丰富了  $NQD$  列方面的结果, 对进一步研究极限理论有一定的理论价值。

## 参考文献 (References)

- [1] E. L. Lehmann. Some concepts of dependence. *The Annals of Mathematical Statistics*, 1966, 37(5): 1137-1153.
- [2] 林正炎, 陆传荣, 苏中根. 随机序列之和极限理论[M]. 北京: 高等教育出版社, 1999: 223-227.
- [3] 邓总纲, 范伟平. 两两广义  $NQD$  列的  $r$  阶平均收敛性和几乎必然收敛性[J]. *Pure Mathematics*, 2011, 1(2): 132-135.
- [4] 甘师信.  $B$  值随机元阵列加权收敛性和大数定律[J]. *武汉大学学报*, 1997, 43(5): 569-574.
- [5] 陆朝阳, 赵选民. 两两  $NQD$  的强收敛性质[J]. *工程数学学报*, 2007, 24(6): 1015-1022.
- [6] 吴群英. 两两  $NQD$  的收敛性质[J]. *数学学报*, 2002, 45(3): 617-624.
- [7] 万成高. 两两  $NQD$  的大数定律和完全收敛性[J]. *应用数学学报*, 2005, 28(2): 253-261.
- [8] 陈平炎. 两两  $NQD$  的强大数定律[J]. *数学物理学报*, 2005, 25(A): 386-392.
- [9] 邓总纲. 两两广义  $NQD$  列的一些性质[J]. *汕头大学学报*, 2009, 2: 20-26.