

บทความวิจัย

ขอบเขตไม่เอกรูปบนการประมาณแบบจุดของการแจกแจง ทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินาม

คณิตร์ ธีรภาพโอฬาร*

บทคัดย่อ

งานวิจัยนี้เราใช้วิธีของสไตน์สำหรับการแจกแจงทวินามและฟังก์ชัน w ที่สัมพันธ์กับตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไป เพื่อหาขอบเขตไม่เอกรูปบนการประมาณการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินาม ผลลัพธ์ของการประมาณดังกล่าวอยู่ในรูปของระยะห่างระหว่างฟังก์ชันการแจกแจงความน่าจะเป็นของตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไปและตัวแปรสุ่มทวินามพร้อมด้วยขอบเขตบนแบบไม่เอกรูป นอกจากนี้เราได้ยกตัวอย่างเชิงตัวเลขบางส่วนเพื่อแสดงผลลัพธ์ของการประมาณนี้

คำสำคัญ: การแจกแจงทวินาม การแจกแจงทวินามทั่วไป การประมาณทวินาม วิธีของสไตน์ ฟังก์ชัน w

A Non-Uniform Bound on Pointwise Approximation of Generalized Binomial Distribution by Binomial Distribution

Kanint Teerapabolarn*

ABSTRACT

In this study, we use Stein's method for the binomial distribution and the w -function associated with generalized binomial random variables to determine a non-uniform bound on the binomial approximation to the generalized binomial distribution, in terms of the distance between generalized binomial and binomial probability distribution functions together with its non-uniform upper bound. Furthermore, we also give some numerical examples to illustrate the result of this approximation.

Keywords: binomial distribution, binomial approximation, generalized binomial distribution, Stein's method, w -function.

บทนำ

การแจกแจงทวินามทั่วไป (generalized binomial distribution) เป็นการแจกแจงวิยุต (discrete distribution) แบบหนึ่งที่ Dwass [5] ได้นำเสนอขึ้นมาเพื่อใช้เป็นการแจกแจงวิยุตที่สามารถใช้อธิบายการแจกแจงที่มีความสำคัญอื่นๆ ได้ครอบคลุมถึงสามการแจกแจง คือ การแจกแจงทวินาม (binomial distribution) การแจกแจงไฮเพอร์จีโอเมตริก (hypergeometric distribution) และการแจกแจงโพลยา (Pólya distribution) การแจกแจงทวินามทั่วไปที่ Dwass [5] ได้นำเสนอ มีภูมิหลังและรูปแบบดังนี้ (สามารถศึกษาเพิ่มเติมได้ใน คณินทร์ วีรภาพโอพาร [1])

สมมติว่าประชากรชุดหนึ่งประกอบด้วยสมาชิกสองประเภทที่แตกต่างกัน คือ ประเภท I และประเภท II กำหนดให้ A และ B แทนปริมาณเริ่มต้นของสมาชิกประเภทที่ I และ II (A และ B ไม่จำเป็นต้องมีค่าเป็นจำนวนเต็ม) สมมติว่าเราสามารถสุ่มตัวอย่างจากประชากรชุดนี้ โดยผลลัพธ์ที่ได้จะต้องเป็นสมาชิกประเภท I หรือ II (อย่างใดอย่างหนึ่งเท่านั้น) ด้วยความน่าจะเป็นที่เป็นสัดส่วนกับปริมาณที่เหลือของสมาชิกแต่ละประเภท และแต่ละครั้งของการสุ่มเราจะนำสมาชิกประเภทเดียวกับสมาชิกที่สุ่มได้ในปริมาณ α ออกจากประชากรที่มีอยู่ในขณะนั้น กรณีที่ α เป็นลบหรือน้อยกว่าศูนย์ เราหมายความว่าให้เพิ่มสมาชิกในปริมาณ $-\alpha$ เข้าไปในประชากร ตัวอย่างเช่น เมื่อเริ่มต้นเราสามารถสุ่มหยิบสมาชิกประเภท I หรือ II ด้วยความน่าจะเป็น $\frac{A}{A+B}$ หรือ $\frac{B}{A+B}$ ถ้าผลลัพธ์ที่สุ่มได้ คือ สมาชิกประเภท I แล้วปริมาณสมาชิกทั้งหมดในประชากรจะมีค่าเพิ่มขึ้นหรือลดลงเป็น $A+B-\alpha$ โดยปริมาณสมาชิกประเภท I จะมีค่าเพิ่มขึ้นหรือลดลงเป็น $A-\alpha$ ส่วนปริมาณสมาชิกประเภท II จะมีค่าเท่าเดิมเป็น B และความน่าจะเป็นแบบมีเงื่อนไข (conditional probability) ของการสุ่มหยิบสมาชิกประเภท I และ II ในการสุ่มครั้งต่อไปจะมีค่าเท่ากับ $\frac{A-\alpha}{A+B-\alpha}$ และ $\frac{B}{A+B-\alpha}$ ตามลำดับ กระบวนการทดลองนี้จะสิ้นสุดเมื่อจำนวนครั้งของการสุ่มในการทำงานเดียวกันนี้ครบ n ครั้ง ($n \in \mathbb{N}$) ให้ X แทนจำนวนครั้งที่สุ่มได้สมาชิกประเภท I ดังนั้นโดยใช้คุณสมบัติที่ว่าผลรวมของความน่าจะเป็นของทุกค่าของตัวแปรสุ่มวิยุต X ต้องมีค่าเท่ากับหนึ่ง และใช้เอกลักษณ์ที่รู้จักกันเป็นอย่างดี [5] คือ $(x+y)^n = \sum_{k=1}^n \binom{n}{k} x^k y^{n-k}$ เมื่อ $x^{(i)} = x(x-\alpha)\dots(x-(i-1)\alpha)$ ดังนั้นฟังก์ชันการแจกแจงความน่าจะเป็นของตัวแปรสุ่ม X จึงเขียนได้เป็น

$$p_X(k) = \binom{n}{k} \frac{A^{(k)} B^{(n-k)}}{(A+B)^{(n)}} , k = 0, 1, \dots, n \quad (1)$$

การแจกแจงที่เขียนอยู่ในรูปของสมการ (1) Dwass [5] เรียกว่า การแจกแจงทวินามทั่วไปที่มีพารามิเตอร์ A, B, α และ n และเรียกตัวแปรสุ่ม X ว่าตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไป โดยมีค่าเฉลี่ยและความแปรปรวนของ X เป็น $\mu = \frac{nA}{A+B}$ และ $\sigma^2 = \frac{nAB(A+B-n\alpha)}{(A+B)(A+B-\alpha)}$ ตามลำดับ เราจะสังเกตได้ว่าการแจกแจงนี้ขึ้นอยู่กับพารามิเตอร์ทั้ง 4 ตัว คือ A, B, α และ n โดยที่ A และ B เป็นจำนวนจริงบวก n เป็นจำนวนเต็มบวก α เป็นจำนวนจริงใดๆ ที่สอดคล้องกับเงื่อนไขหรือข้อจำกัดที่ว่า $\alpha(n-1) \leq A+B$ และ $A^{(i)}$ และ $B^{(i)}$ จะต้องไม่เป็นจำนวนลบสำหรับ $i = 1, \dots, n$ และในกรณีที่ $\alpha \neq 0$ ค่าความน่าจะเป็น $p_X(k)$ ในสมการ (1) จะกำหนดโดย $\frac{A}{\alpha}, \frac{B}{\alpha}$ และ n โดยเฉพาะอย่างยิ่งค่าของ α สามารถทำให้การแจกแจงนี้เปลี่ยนรูปแบบไปเป็นการแจกแจงที่

สำคัญอื่นๆ ได้ ซึ่งสามารถศึกษาเพิ่มเติมได้จาก Wongkasem และคณะ [8] หรือ คณินทร์ ชีรภาพโอพาร [1] พิจารณาฟังก์ชันการแจกแจงความน่าจะเป็นในสมการ (1) เราสามารถเขียนใหม่ได้เป็น

$$p_X(k) = \binom{n}{k} \frac{[A(A-\alpha)\dots(A-(k-1)\alpha)][B(B-\alpha)\dots(B-(n-k-1)\alpha)]}{(A+B)(A+B-\alpha)\dots(A+B-(n-1)\alpha)}$$

$$= \binom{n}{k} \frac{\left[\frac{A}{A+B} \frac{(A-\alpha)}{A+B} \dots \frac{(A-(k-1)\alpha)}{A+B} \right] \left[\frac{B}{A+B} \frac{(B-\alpha)}{A+B} \dots \frac{(B-(n-k-1)\alpha)}{A+B} \right]}{\frac{(A+B)}{A+B} \frac{(A+B-\alpha)}{A+B} \dots \frac{(A+B-(n-1)\alpha)}{A+B}} \quad (2)$$

จากสมการ (2) เราจะเห็นว่าถ้า $A+B$ ลู่เข้าสู่ค่าอนันต์ และ $\frac{A}{A+B}$ ลู่เข้าสู่เป็นค่าคงตัว p แล้วการแจกแจงทวินามทั่วไปที่มีพารามิเตอร์ A, B, α และ n จะลู่เข้าสู่การแจกแจงทวินามที่มีพารามิเตอร์ n และ p นั่นคือ $p_X(k) = \binom{n}{k} \frac{A^k B^{n-k}}{(A+B)^n} \rightarrow \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}$ สำหรับทุก $k = 0, 1, \dots, n$ และทุกจำนวนจริง α ดังนั้นเราสามารถประมาณการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินาม ถ้าหากว่าเรากำหนดเงื่อนไขของพารามิเตอร์ของทั้งสองการแจกแจงมีความสอดคล้องกัน ดังเช่นในงานวิจัยของ Wongkasem และคณะ [8] ได้ใช้วิธีของสไตน์ (Stein's method) สำหรับการแจกแจงทวินามพร้อมด้วยฟังก์ชัน w (w -function) ที่สัมพันธ์กับตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไปมาประมาณการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินาม โดยอยู่ในรูปของผลต่างระหว่างการแจกแจงทวินามทั่วไป และการแจกแจงทวินามพร้อมด้วยขอบเขตบนแบบเอกรูป (uniform upper bound) ดังนี้

$$\left| \sum_{k \in E} p_X(k) - \sum_{k \in E} b(k; n, p) \right| \leq \left(1 - p^{n+1} - (1-p)^{n+1} \right) \frac{n(n-1)|\alpha|}{(n+1)(A+B-\alpha)} \quad (3)$$

โดยที่ E คือ เซตย่อยของเซต $\{0, \dots, n\}$, $p = \frac{A}{A+B}$ และ $b(k; n, p) \equiv \binom{n}{k} p^k (1-p)^{n-k}$

จากสมการ (3) ถ้า $E = \{x_0\}$ เมื่อ $x_0 \in \{0, \dots, n\}$ เราจะได้ว่า

$$|p_X(x_0) - b(x_0; n, p)| \leq \left(1 - p^{n+1} - (1-p)^{n+1} \right) \frac{n(n-1)|\alpha|}{(n+1)(A+B-\alpha)} \quad (4)$$

เราสามารถสังเกตได้ว่าขอบเขตบนทางด้านขวามือของสมการ (4) จะไม่เปลี่ยนแปลงสำหรับทุกค่าของ $x_0 \in \{0, \dots, n\}$ ซึ่งอาจทำให้การประมาณการแจกแจงข้างต้นไม่สอดคล้องกับค่าของ x_0 ที่เปลี่ยนไป แต่ถ้าขอบเขตบนทางด้านขวามือของสมการ (4) สามารถเปลี่ยนแปลงไปตามค่าของ x_0 ในลักษณะที่ทำให้การประมาณการแจกแจงมีความถูกต้องมากขึ้นก็จะเป็นผลดีมากกว่า ในงานวิจัยนี้เราต้องการการประมาณการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินามในรูปแบบเช่นเดียวกับสมการ (4) แต่ขอบเขตบนของการประมาณจะอยู่ในรูปแบบไม่เอกรูป (non-uniform upper bound) ดังนั้นวัตถุประสงค์ของการวิจัยนี้คือหาขอบเขตบนไม่เอกรูปบนการประมาณแบบจุดของการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินาม

วิธีดำเนินการวิจัย

ในการดำเนินการหาผลลัพท์หลักที่อยู่ในรูปแบบที่คล้ายกับสมการ (4) เราจะดำเนินการหาโดยใช้วิธีของสไตน์สำหรับการแจกแจงทวินามพร้อมด้วยฟังก์ชัน w ที่สัมพันธ์กับตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไป เราควรเริ่มต้นด้วยการหารูปแบบของฟังก์ชัน w แล้วจึงสร้างบทตั้ง (lemma) ที่จำเป็นสำหรับการพิสูจน์ทฤษฎีบทหลักต่อไป

1. ฟังก์ชัน w ที่สัมพันธ์กับตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไป

ให้ตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไป X มีฟังก์ชันการแจกแจงความน่าจะเป็น $p_x(k)$ ที่กำหนดเช่นเดียวกับในสมการ (1) และ $p_x(k) > 0$ สำหรับทุก $k \in \{0, 1, \dots, n\}$ แล้วเราจะได้ฟังก์ชัน w ที่สัมพันธ์กับตัวแปรสุ่ม X ดังบทตั้งต่อไปนี้

บทตั้ง 1 ให้ $w(X)$ เป็นฟังก์ชัน w ที่สัมพันธ์กับตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไป X แล้ว

$$w(k) = \frac{(n-k)(A-k\alpha)}{(A+B)\sigma^2}, \quad k=0, 1, \dots, n \quad (5)$$

$$\text{โดยที่ } \sigma^2 = \frac{nAB(A+B-n\alpha)}{(A+B)^2(A+B-\alpha)}$$

พิสูจน์ ดูได้ใน Wongkasem และคณะ [8]

รูปแบบความสัมพันธ์ต่อไปนี้เป็นคุณสมบัติที่สำคัญของฟังก์ชัน w สำหรับการหาผลลัพท์หลัก ซึ่ง Cacoullos และ Papathanasiou [4] ได้กำหนดไว้ดังนี้

ถ้าตัวแปรสุ่มที่มีค่าจำนวนเต็มและไม่เป็นลบ (non-negative integer-valued random variable) X มี $p_x(k) > 0$ สำหรับทุก k ในเซตค้ำจุนของ X (support of X) และความแปรปรวน $0 < \sigma^2 < \infty$ แล้ว

$$\text{Cov}(X, g(X)) = \sigma^2 E[w(X)\Delta g(X)] \quad (6)$$

สำหรับฟังก์ชัน $g : \mathbb{N} \cup \{0\} \rightarrow \mathbb{R}$ ซึ่งทำให้ $E[w(X)\Delta g(X)] < \infty$ โดยที่ $\Delta g(x) = g(x+1) - g(x)$ และเราจะสังเกตได้ว่า $E[w(X)] = 1$ (เมื่อกำหนด $g(x) = x$ สำหรับทุกตัวแปรสุ่มที่มีค่าจำนวนเต็มและไม่เป็นลบ X)

2. วิธีของสไตน์สำหรับการแจกแจงทวินาม

วิธีของสไตน์ได้เริ่มต้นประมาณปี 1972 โดย Stein [6] ได้นำเสนอวิธีทั่วไปที่มีประสิทธิภาพในการประมาณการแจกแจงของผลรวมของตัวแปรสุ่มที่มีความสัมพันธ์กัน (dependent random variables) ด้วยการแจกแจงปกติ (normal distribution) ต่อมา Chen [3] ได้ปรับและพัฒนาวิธีของสไตน์แบบเดิมมาสู่การประมาณการแจกแจงของผลรวมของตัวแปรสุ่มแบร์นูลลีที่มีความสัมพันธ์กัน (dependent Bernoulli random variables) ด้วยการแจกแจงปัวซอง (Poisson distribution) และประมาณปี 1986 วิธีของสไตน์จึงได้ปรับและพัฒนาสู่การประมาณการแจกแจงของตัวแปรสุ่มด้วยการแจกแจงทวินามโดย Stein [7] วิธีของสไตน์เริ่มต้นด้วยสมการของสไตน์ (Stein's equation) ของแต่ละการแจกแจงที่สมนัยกัน และสมการ

ของสไตน์สำหรับการแจกแจงทวินามที่มีพารามิเตอร์ $n \geq 1$ และ $p = 1-q \in (0,1)$ (เมื่อกำหนดฟังก์ชัน h) นิยามโดย

$$(n-x)pg(x+1) - qxg(x) = h(x) - \mathcal{B}_{n,p}(h) \tag{7}$$

โดยที่ $\mathcal{B}_{n,p}(h) = \sum_{k=0}^n h(k) \binom{n}{k} p^k q^{n-k}$ และ g และ h เป็นฟังก์ชันค่าจริงที่มีขอบเขตที่นิยามบนเซต $\{0,1,\dots,n\}$

สำหรับ $E \subseteq \{0,1,\dots,n\}$ ให้ $h_E : \{0,1,\dots,n\} \rightarrow \mathbb{R}$ เป็นฟังก์ชันที่กำหนดโดย

$$h_E(x) = \begin{cases} 1, & x \in E \\ 0, & x \notin E \end{cases}$$

ต่อไปเราจะพิจารณาเช่นเดียวกับ Barbour และคณะ [2] หน้า 189 โดยให้ $g_E : \mathbb{N} \cup \{0\} \rightarrow \mathbb{R}$ เป็นฟังก์ชันที่สอดคล้องสมการ (7) โดยที่ $g_E(0) = g_E(1)$ และ $g_E(x) = g_E(n)$ สำหรับทุก $x \geq n$

สำหรับ $E = \{x_0\}$ เมื่อ $x_0 \in \{0,\dots,n\}$ เราสามารถเขียนผลเฉลย $g_{x_0} = g\{x_0\}$ ของสมการ (7) ได้เป็น

$$g_{x_0}(x) = \begin{cases} \frac{\binom{n}{x_0} p^{x_0-x} \mathcal{B}_{n,p}(1-h_{C_{x-1}})}{x \binom{n}{x} q^{x_0-(x-1)}}, & x_0 < x \\ \frac{\binom{n}{x_0} p^{x_0-x} \mathcal{B}_{n,p}(h_{C_{x-1}})}{x \binom{n}{x} q^{x_0-(x-1)}}, & x_0 \geq x \geq 1 \end{cases} \tag{8}$$

โดยที่ $C_x = \{0,\dots,x\}$

จากผลเฉลยในสมการ (8) เราสามารถสร้างบทตั้งเพื่อช่วยในการพิสูจน์ทฤษฎีบทที่จะกล่าวถึงในหัวข้อต่อไปได้ ดังนี้

บทตั้ง 2 สำหรับ $x_0 \in \{0, \dots, n\}$ ให้ $\Delta g_{x_0}(x) = g_{x_0}(x+1) - g_{x_0}(x)$ และ $n > 1$ แล้วเราจะได้ว่าอสมการต่อไปนี้เป็นจริง

$$\sup_{x \geq 1} |\Delta g_{x_0}(x)| \leq \begin{cases} \frac{np + q^n - 1}{(n-1)np^2} & , x_0 = 0 \\ \frac{1 - q^{n-1}}{(n-1)p} & , x_0 = 1 \\ \min \left\{ \frac{1 - p^n}{qx_0}, \frac{1 - p^{n+1} - q^{n+1}}{(n+1)pq} \right\} & , x_0 \geq 2 \end{cases} \quad (9)$$

พิสูจน์ เราแบ่งการพิสูจน์ออกเป็นสองกรณี ดังนี้

กรณี 1 $x_0 = 0$

ในกรณีนี้โดย Barbour และคณะ [2] เราจะได้ว่า g_0 เป็นฟังก์ชันลดและมีค่ามากกว่าศูนย์ สำหรับ $x \in \{1, \dots, n\}$ ดังนั้นสำหรับ $x \in \{1, \dots, n\}$ เราจะได้

$$\begin{aligned} |\Delta g_0(x)| &= g_0(x) - g_0(x+1) \\ &= \frac{\sum_{k=x}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{x \binom{n}{x} p^x q^{n-x}} - \frac{\sum_{k=x+1}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{(x+1) \binom{n}{x+1} p^{x+1} q^{-x}} \\ &= \frac{q^{n-1}}{x \binom{n}{x} p^x q^{n-x}} \left\{ \sum_{k=x}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k} - \sum_{k=x}^{n-1} \binom{n}{k} p^k q^{n-k} \frac{x(n-k)}{(k+1)(n-k)} \right\} \\ &= \frac{q^{n-1}}{x \binom{n}{x} p^x q^{n-x}} \sum_{k=x}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k} \left\{ 1 - \frac{x(n-k)}{(k+1)(n-x)} \right\} \\ &\leq \frac{q^{n-1}}{npq^{n-1}} \sum_{k=1}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k} \left\{ 1 - \frac{n-k}{(k+1)(n-1)} \right\} \\ &= g_0(1) - g_0(2) \\ &= \frac{1 - q^n}{np} - \frac{q(1 - q^n - npq^{n-1})}{(n-1)np^2} \\ &= \frac{np + q^n - 1}{(n-1)np^2} \end{aligned}$$

กรณี 2 $x_0 \geq 1$

โดย Barbour และคณะ [2] เราจะได้ว่า g_{x_0} เป็นฟังก์ชันลดและมีค่าน้อยกว่าศูนย์สำหรับ $x \in \{1, \dots, x_0\}$ และ g_{x_0} เป็นฟังก์ชันลดและมีค่ามากกว่าศูนย์ สำหรับ $x \in \{x_0 + 1, x_0 + 2, \dots, n\}$ ดังนั้นเราจะได้ว่า $|\Delta g_{x_0}(x)| \leq g_{x_0}(x_0 + 1) - g_{x_0}(x_0)$

พิจารณา $x_0 = 1$ เราจะได้

$$\begin{aligned} |\Delta g_1(x)| &\leq g_1(2) - g_1(1) \\ &= \frac{\sum_{k=2}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{(n-1)p} + \frac{\sum_{k=0}^0 \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{q} \\ &= \frac{1 - q^n - npq^{n-1}}{(n-1)p} + q^{n-1} \\ &= \frac{1 - q^{n-1}}{(n-1)p} \end{aligned}$$

พิจารณา $x_0 \geq 2$ เราจะได้

$$|\Delta g_{x_0}(x)| \leq \frac{\sum_{k=x_0+1}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{(n-x_0)p} + \frac{\sum_{k=0}^{x_0-1} \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{qx_0} \quad (10)$$

$$\begin{aligned} &= \frac{1}{qx_0} \left\{ \sum_{k=x_0+1}^n \binom{n}{k-1} p^{k-1} q^{n-(k-1)} \frac{x_0(n-k+1)}{k(n-x_0)} + \sum_{k=0}^{x_0-1} \binom{n}{k} p^k q^{n-k} \right\} \\ &\leq \frac{1}{qx_0} \left\{ \sum_{k=x_0}^{n-1} \binom{n}{k} p^k q^{n-k} + \sum_{k=0}^{x_0-1} \binom{n}{k} p^k q^{n-k} \right\} \\ &= \frac{1 - p^n}{qx_0} \quad (11) \end{aligned}$$

และจาก (10) จะได้

$$\begin{aligned}
 |\Delta g_{x_0}(x)| &\leq \frac{\sum_{k=x_0+1}^n \frac{n!}{k!(n-k)!(n-x_0)} p^k q^{n+1-k}}{qp} + \frac{\sum_{k=0}^{x_0-1} \frac{n!}{x_0 k!(n-k)!} p^{k+1} q^{n-k}}{pq} \\
 &\leq \frac{\sum_{k=x_0+1}^n \frac{(n+1)!}{k!(n+1-k)!} p^k q^{n+1-k} \binom{n+1-k}{n-x_0}}{(n+1)qp} + \frac{\sum_{k=0}^{x_0-1} \frac{(n+1)!}{(k+1)!(n-k)!} p^{k+1} q^{n-k} \binom{k+1}{x_0}}{(n+1)pq} \\
 &\leq \frac{1}{(n+1)pq} \left\{ \sum_{k=x_0+1}^n \binom{n+1}{k} p^k q^{n+1-k} + \sum_{k=1}^{x_0} \binom{n+1}{k} p^k q^{n+1-k} \right\} \\
 &= \frac{1 - p^{n+1} - q^{n+1}}{(n+1)pq} \tag{12}
 \end{aligned}$$

จากอสมการ (11) และ (12) เราจะได้

$$|\Delta g_{x_0}(x)| \leq \min \left\{ \frac{1-p^n}{qx_0}, \frac{1-p^{n+1}-q^{n+1}}{(n+1)pq} \right\}$$

ดังนั้น จากการพิสูจน์ทั้งสองกรณีเราจะได้อสมการ (9) เป็นจริง

ผลการวิจัย

ผลการวิจัยที่เราต้องการในงานวิจัยนี้ คือ ขอบเขตบนไม่เอกรูปบนการประมาณแบบจุดของการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินาม (หาได้โดยใช้วิธีของสไตน์สำหรับการแจกแจงทวินามและฟังก์ชัน w ที่สัมพันธ์กับตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไป) และทฤษฎีบทต่อไปนี้ เป็นผลลัพธ์ของการประมาณดังกล่าว

ทฤษฎีบท 1 ให้ X เป็นตัวแปรสุ่มทวินามทั่วไป และ $p = \frac{A}{A+B}$ แล้วจะได้ว่า

$$|p_X(x_0) - b(x_0; n, p)| \leq \begin{cases} \frac{(np + q^n - 1)B |\alpha|}{(A+B-\alpha)A} & , x_0 = 0 \\ \frac{(1-q^{n-1})qn |\alpha|}{A+B-\alpha} & , x_0 = 1 \\ \frac{n(n-1) |\alpha|}{A+B-\alpha} \min \left\{ \frac{(1-p^n)p}{x_0}, \frac{1-p^{n+1}-q^{n+1}}{n+1} \right\} & , x_0 \in \{2, \dots, n\} \end{cases}$$

พิสูจน์ จากสมการ (7) เมื่อแทน x ด้วย X และให้ $h = h_{x_0}$ แล้วหาค่าคาดหวังตลอดสมการเราจะได้

$$\begin{aligned}
 p_X(x_0) - b(x_0; n, p) &= E[(n - X)pg_{x_0}(X + 1) - qXg_{x_0}(X)] \\
 &= E[ng_{x_0}(X + 1) - pX\Delta g_{x_0}(X) - Xg_{x_0}(X)] \\
 &= E[\mu g_{x_0}(X + 1)] - pE[X\Delta g_{x_0}(X)] - E[Xg_{x_0}(X)] \\
 &= E[\mu g_{x_0}(X + 1)] - pE[X\Delta g_{x_0}(X)] - Cov(X, g_{x_0}(X)) - E[\mu g_{x_0}(X)] \\
 &= E[\mu\Delta g_{x_0}(X)] - pE[X\Delta g_{x_0}(X)] - Cov(X, g_{x_0}(X)) \tag{13}
 \end{aligned}$$

โดยที่ g_{x_0} นิยามเช่นเดียวกับสมการ (9) และจากบทตั้ง 2 เราจะได้ $E|w(X)\Delta g_{x_0}(X)| < \infty$ ดังนั้นโดยสมการ (6) เราสามารถเขียนสมการ (13) ใหม่ได้เป็น

$$\begin{aligned}
 |p_X(x_0) - b(x_0; n, p)| &\leq |E[\mu\Delta g_{x_0}(X)] - pE[X\Delta g_{x_0}(X)] - \sigma^2 E[w(X)\Delta g_{x_0}(X)]| \\
 &= |E[(\mu - pX - \sigma^2 w(X))\Delta g_{x_0}(X)]| \\
 &\leq E[|\mu - pX - \sigma^2 w(X)| |\Delta g_{x_0}(X)|] \\
 &\leq \sup_{x \geq 1} |\Delta g_{x_0}(x)| E|\mu - pX - \sigma^2 w(X)| \tag{14}
 \end{aligned}$$

เนื่องจาก $\mu - pk - \sigma^2 w(k) = \frac{nA}{A+B} - \frac{kA}{A+B} - \frac{(n-k)(A-k\alpha)}{A+B} = \frac{(n-k)k\alpha}{A+B}$ ซึ่งมากกว่าหรือเท่ากับศูนย์

เมื่อ $\alpha \geq 0$ และน้อยกว่าศูนย์ เมื่อ $\alpha < 0$ นั่นคือสำหรับ $\alpha \geq 0$ เราจะได้ว่า $E|\mu - pX - \sigma^2 w(X)| =$

$$\mu - pE(X) - \sigma^2 E[w(X)] = \frac{pqn(n-1)\alpha}{A+B-\alpha} \text{ และสำหรับ } \alpha < 0 \text{ เราจะได้ว่า } E|\mu - pX - \sigma^2 w(X)| =$$

$$-\frac{pqn(n-1)\alpha}{A+B-\alpha} \text{ ดังนั้นจึงทำให้ } E|\mu - pX - \sigma^2 w(X)| = \frac{pqn(n-1)|\alpha|}{A+B-\alpha} \text{ เมื่อแทนค่าใน (14) จะได้ว่า}$$

$$|p_X(x_0) - b(x_0; n, p)| \leq \sup_{x \geq 1} |\Delta g_{x_0}(x)| \frac{pqn(n-1)|\alpha|}{A+B-\alpha} \tag{15}$$

และโดยใช้บทตั้ง 2 กับสมการ (15) เราจะได้ผลลัพธ์ตามที่ต้องการ

บทแทรก 1 สำหรับ $n \geq 2$ และ $0 < p < 1$ แล้วจะได้ว่า

$$1. \min \left\{ \frac{1-p^n}{qx_0}, \frac{1-p^{n+1}-q^{n+1}}{(n+1)pq} \right\} \leq \frac{1-p^{n+1}-q^{n+1}}{(n+1)pq} \text{ สำหรับ } x_0 \in \{2, \dots, n\} \tag{16}$$

$$2. \frac{np+q^n-1}{(n-1)np^2} < \frac{1-q^{n-1}}{(n-1)p} \leq \frac{1-p^{n+1}-q^{n+1}}{(n+1)pq} \tag{17}$$

พิสูจน์ 1. เราเห็นได้ชัดว่าอสมการ (16) เป็นจริง

2. เริ่มต้นเราจะแสดงว่าอสมการทางซ้ายมือของ (17) หรือ $\frac{np+q^n-1}{(n-1)np^2} < \frac{1-q^{n-1}}{(n-1)p}$ เป็นจริง

เนื่องจาก $\frac{np+q^n-1}{(n-1)np^2} = \frac{1-q^n}{np} - \frac{q(1-q^n-npq^{n-1})}{(n-1)np^2} < \frac{1-q^n}{np}$ ซึ่งถ้าเราแสดงว่า

$\frac{1-q^n}{np} < \frac{1-q^{n-1}}{(n-1)p}$ เป็นจริง แล้วจะได้ว่าอสมการข้างต้นเป็นจริงด้วย

เพราะว่า $nq^{n-1} < 1 + \dots + q^{n-1}$ และ $p(1 + \dots + q^{n-1}) = 1 - q^n$ แล้วเราจะได้ว่า $npq^{n-1} < 1 - q^n$ และ

$$\begin{aligned} npq^{n-1} < 1 - q^n &\Rightarrow nq^{n-1} - nq^n - 1 + q^n < 0 \\ &\Rightarrow n - 1 - (n-1)q^n < n - nq^{n-1} \\ &\Rightarrow (n-1)(1 - q^n) < n(1 - q^{n-1}) \\ &\Rightarrow \frac{1 - q^n}{np} < \frac{1 - q^{n-1}}{(n-1)p} \end{aligned}$$

ดังนั้นเราจะได้ว่าอสมการทางซ้ายมือของ (17) เป็นจริง

ต่อไปเราจะแสดงว่า $\frac{1 - q^{n-1}}{(n-1)p} \leq \frac{1 - p^{n+1} - q^{n+1}}{(n+1)pq}$

เนื่องจาก $\frac{1 - q^{n-1}}{(n-1)p} = \frac{\sum_{k=2}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{(n-1)p} + \frac{\sum_{k=0}^0 \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{q}$ และ

$$\begin{aligned} \frac{\sum_{k=2}^n \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{(n-1)p} + \frac{\sum_{k=0}^0 \binom{n}{k} p^k q^{n-k}}{q} &= \frac{\sum_{k=2}^n \frac{(n+1)!}{k!(n+1-k)!} p^k q^{n+1-k} \left(\frac{n+1-k}{n-1}\right)}{(n+1)qp} + \frac{(n+1)pq^{n+1-1}}{(n+1)pq} \\ &\leq \frac{1}{(n+1)pq} \left\{ \sum_{k=2}^n \binom{n+1}{k} p^k q^{n+1-k} + (n+1)pq^{n+1-1} \right\} \\ &= \frac{1 - p^{n+1} - q^{n+1}}{(n+1)pq} \end{aligned}$$

ดังนั้นเราจะได้ว่าอสมการ (17) เป็นจริง \square

บทแทรก 1 สร้างขึ้นมาเพื่อใช้ในการเปรียบเทียบผลลัพธ์ทั้งหมดในทฤษฎีบท 1 และผลลัพธ์ในอสมการ (4) และโดยบทแทรก 1 เราพบว่าขอบเขตบนแบบไม่เอกรูปของผลลัพธ์ทั้งหมดในทฤษฎีบท 1 ดีกว่าขอบเขตบนแบบเอกรูปในอสมการ (4)

บทแทรกที่จะกล่าวถึงต่อไปนี้เป็นผลลัพธ์โดยตรงที่ได้มาจากทฤษฎีบท 1 ซึ่งเกี่ยวข้องกับการประมาณแบบจุดของการแจกแจงไฮเพอร์จีโอเมตริกและการแจกแจงโพลยาด้วยการแจกแจงทวินาม

บทแทรก 2 ถ้า $\alpha > 0$ และ A/α และ B/α เป็นจำนวนเต็มแล้วเราจะได้ว่า

$$|h(x_0; A, B, n, \alpha) - b(x_0; n, p)| \leq \begin{cases} \frac{(np + q^n - 1)B\alpha}{(A + B - \alpha)A} & , x_0 = 0 \\ \frac{(1 - q^{n-1})qn\alpha}{A + B - \alpha} & , x_0 = 1 \\ \frac{n(n-1)\alpha}{A + B - \alpha} \min \left\{ \frac{(1 - p^n)p}{x_0}, \frac{1 - p^{n+1} - q^{n+1}}{n+1} \right\} & , x_0 \in \{2, \dots, n\} \end{cases}$$

โดยที่ $h(x_0; A, B, n, \alpha) \equiv \frac{\binom{A/\alpha}{x_0} \binom{B/\alpha}{n-x_0}}{\binom{A/\alpha + B/\alpha}{n}}$ คือ ฟังก์ชันการแจกแจงความน่าจะเป็นของตัวแปรสุ่ม

ไฮเพอร์จีโอเมตริกที่มีพารามิเตอร์ A, B, α และ n

บทแทรก 3 สำหรับ $\alpha < 0$ เราจะได้ว่า

$$|py(x_0; A, B, n, \alpha) - b(x_0; n, p)| \leq \begin{cases} \frac{(np + q^n - 1)B(-\alpha)}{(A + B - \alpha)A} & , x_0 = 0 \\ \frac{(1 - q^{n-1})qn(-\alpha)}{A + B - \alpha} & , x_0 = 1 \\ \frac{n(n-1)(-\alpha)}{A + B - \alpha} \min \left\{ \frac{(1 - p^n)p}{x_0}, \frac{1 - p^{n+1} - q^{n+1}}{n+1} \right\} & , x_0 \in \{2, \dots, n\} \end{cases}$$

โดยที่ $py(x_0; A, B, n, \alpha) \equiv \frac{\binom{-A/\alpha + x_0 - 1}{x_0} \binom{-B/\alpha + n - x_0 - 1}{n - x_0}}{\binom{-A/\alpha - B/\alpha + n - 1}{n}}$ คือ ฟังก์ชันการแจกแจงความน่าจะเป็น

ของตัวแปรสุ่มโพลยาที่มีพารามิเตอร์ A, B, α และ n

ผลลัพธ์ในทฤษฎีบท 1 หรือในบทแทรก 2 และ 3 จะเป็นผลการประมาณทวินามที่ดี ถ้าหากว่า α และ/หรือ n และ/หรือ A มีค่าน้อย และ $A + B - \alpha$ มีค่ามาก ซึ่งสอดคล้องกับเงื่อนไขของการลู่อเข้าที่ได้กล่าวมาแล้ว

ตัวอย่างเชิงตัวเลข

ตัวอย่างเชิงตัวเลขต่อไปนี้เป็นเพียงตัวอย่างบางส่วนที่นำมาแสดงให้เห็นว่าการประมาณแบบจุดของการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินามมีความเหมาะสมอย่างไร (โดยพิจารณาจากขอบเขตบนของการประมาณดังกล่าว) และตัวอย่างเชิงตัวเลขสำหรับงานวิจัยนี้เป็นการแสดงการประยุกต์ใช้ผลลัพธ์ในทฤษฎีบท 1 ในส่วนที่เกี่ยวข้องกับการแจกแจงไฮเพอร์จีโอเมตริกและการแจกแจงโพลยา (ในบทแทรก 2 และ 3) ดังนี้

ตัวอย่าง 1 กำหนดให้ $n = 5$, $A = 30$, $A + B = 1000$ และ $\alpha = 1$ แล้วผลลัพธ์เชิงตัวเลขที่ได้คือ

1. สำหรับขอบเขตบนแบบเอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 5, 0.03)| \leq 0.000557317, x_0 = 0, 1, \dots, 5$$

2. สำหรับขอบเขตบนแบบไม่เอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 5, 0.03)| \leq \begin{cases} 0.000282683, & x_0 = 0 \\ 0.000556887, & x_0 = 1 \\ 0.000300301, & x_0 = 2 \\ \frac{0.000600601}{x_0}, & x_0 = 3, 4, 5 \end{cases}$$

ตัวอย่าง 2 กำหนดให้ $n = 10$, $A = 50$, $A + B = 1000$ และ $\alpha = 1$ แล้วผลลัพธ์เชิงตัวเลขที่ได้คือ

1. สำหรับขอบเขตบนแบบเอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 10, 0.05)| \leq 0.003531531, x_0 = 0, 1, \dots, 10$$

2. สำหรับขอบเขตบนแบบไม่เอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 10, 0.05)| \leq \begin{cases} 0.001877880, & x_0 = 0 \\ 0.003516147, & x_0 = 1 \\ 0.002252252, & x_0 = 2 \\ \frac{0.004504505}{x_0}, & x_0 = 3, \dots, 10 \end{cases}$$

ตัวอย่าง 3 กำหนดให้ $n = 20$, $A = 100$, $A + B = 1000$ และ $\alpha = 1$ แล้วผลลัพธ์เชิงตัวเลข
ที่ได้ คือ

1. สำหรับขอบเขตบนแบบเอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 20, 0.1)| \leq 0.016131407, x_0 = 0, 1, \dots, 20$$

2. สำหรับขอบเขตบนแบบไม่เอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 20, 0.1)| \leq \begin{cases} 0.010104294, & x_0 = 0 \\ 0.015584051, & x_0 = 1 \\ 0.016131407, & x_0 = 2 \\ \frac{0.038038038}{x_0}, & x_0 = 3, \dots, 20 \end{cases}$$

ตัวอย่าง 4 กำหนดให้ $n = 10$, $A = 50$, $A + B = 1000$ และ $\alpha = -1$ แล้วผลลัพธ์เชิงตัวเลข
ที่ได้ คือ

1. สำหรับขอบเขตบนแบบเอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 10, 0.05)| \leq 0.003524475, x_0 = 0, 1, \dots, 10$$

2. สำหรับขอบเขตบนแบบไม่เอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 10, 0.05)| \leq \begin{cases} 0.001874128, & x_0 = 0 \\ 0.003509121, & x_0 = 1 \\ 0.002247752, & x_0 = 2 \\ \frac{0.004495504}{x_0}, & x_0 = 3, \dots, 10 \end{cases}$$

ตัวอย่าง 5 กำหนดให้ $n = 15$, $A = 100$, $A + B = 1000$ และ $\alpha = -1$ แล้วผลลัพธ์เชิง
ตัวเลขที่ได้ คือ

1. สำหรับขอบเขตบนแบบเอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 15, 0.1)| \leq 0.010682229, x_0 = 0, 1, \dots, 15$$

2. สำหรับขอบเขตบนแบบไม่เอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 15, 0.1)| \leq \begin{cases} 0.006346674, & x_0 = 0 \\ 0.010401232, & x_0 = 1 \\ 0.010489511, & x_0 = 2 \\ \frac{0.020979021}{x_0}, & x_0 = 3, \dots, 15 \end{cases}$$

ตัวอย่าง 6 กำหนดให้ $n = 25$, $A = 150$, $A + B = 1000$ และ $\alpha = -1$ แล้วผลลัพธ์เชิงตัวเลขที่ได้ คือ

1. สำหรับขอบเขตบนแบบเอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 25, 0.15)| \leq 0.022716865, x_0 = 0, 1, \dots, 25$$

2. สำหรับขอบเขตบนแบบไม่เอกรูป

$$|p_X(x_0) - b(x_0; 25, 0.15)| \leq \begin{cases} 0.015665122, & x_0 = 0 \\ 0.020799255, & x_0 = 1 \\ 0.022716865, & x_0 = 2, 3 \\ \frac{0.08991009}{x_0}, & x_0 = 4, \dots, 25 \end{cases}$$

ผลลัพธ์เชิงตัวเลขในตัวอย่าง 1 ถึง 6 ได้ชี้ให้เห็นว่าขอบเขตบนของการประมาณจะมีค่าน้อยถ้าหากว่า n และ/หรือ A มีค่าน้อย และ $A+B-\alpha$ มีค่ามาก ซึ่งแสดงว่าการประมาณการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินามจะมีประสิทธิภาพเมื่อ n และ/หรือ A มีค่าน้อย และ $A+B-\alpha$ มีค่ามาก และเมื่อเปรียบเทียบขอบเขตบนที่ได้มาจากอสมการ (4) และทฤษฎีบท 1 ของผลลัพธ์เชิงตัวเลขในตัวอย่าง 1 ถึง 6 เราจะเห็นได้ว่าขอบเขตบนที่ได้มาจากทฤษฎีบท 1 (ขอบเขตบนแบบไม่เอกรูป) ดีกว่าขอบเขตบนที่ได้มาจากอสมการ (4) (ขอบเขตบนแบบเอกรูป)

สรุปผลการวิจัย

การแจกแจงทวินามทั่วไปเป็นการแจกแจงวิชุดแบบหนึ่งที่ครอบคลุมการแจกแจงที่สำคัญถึงสามการแจกแจง คือ การแจกแจงทวินาม การแจกแจงไฮเพอร์จีโอเมตริก และการแจกแจงโพลยา ซึ่งเราจะเห็นว่าการแจกแจงนี้สัมพันธ์กับการแจกแจงทวินามเป็นอย่างมาก และเมื่อได้ศึกษาเรื่องของการลู่เข้าของการแจกแจงทวินามทั่วไป เราสามารถสรุปได้ว่า ถ้า $A+B \rightarrow \infty$ และ $\frac{A}{A+B}$ ลู่เข้าสู่เป็นค่าคงตัว p แล้วการแจกแจงทวินามทั่วไปที่มีพารามิเตอร์ A, B, α และ n จะลู่เข้าสู่การแจกแจงทวินามที่มีพารามิเตอร์ n และ p จากผลที่ได้นี้สามารถเชื่อมโยงไปสู่เรื่องของการประมาณแบบจุดของการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินาม โดยมีขอบเขตบนของการประมาณเป็นหลักเกณฑ์ทั่วไปที่นำมาใช้ประมาณค่าผลต่างระหว่างการแจกแจงทวินามทั่วไปและการแจกแจงทวินาม ซึ่งเราสามารถให้หลักเกณฑ์นี้เป็นเครื่องมือในการวัดความถูกต้องของการประมาณการแจกแจงดังกล่าวได้ กล่าวคือ ถ้าขอบเขตบนดังกล่าวมีค่าน้อยแสดงว่าการแจกแจงทวินามสามารถประมาณการแจกแจงทวินามทั่วไปได้ดี หรือแสดงว่าการแจกแจงทวินามทั่วไปเข้าใกล้การแจกแจงทวินาม ในทางกลับกันถ้าขอบเขตบนมีค่ามากแสดงว่าการประมาณการแจกแจงดังกล่าวไม่มีความเหมาะสม และขอบเขตบนดังกล่าวจะมีค่ามากหรือน้อยนั้นมักจะขึ้นอยู่กับค่าพารามิเตอร์ของการแจกแจงที่มีความสอดคล้องกัน ซึ่งจากผลการวิจัยที่ได้เราพบว่าการประมาณการแจกแจงทวินามทั่วไปด้วยการแจกแจงทวินามจะมีความเหมาะสมเมื่อ α และ/หรือ n และ/หรือ A มีค่าน้อย และ $A + B - \alpha$ มีค่ามาก และเมื่อเปรียบเทียบขอบเขตบนในอสมการ (4) และทฤษฎีบท 1 เราพบว่าขอบเขตบนแบบไม่เอกรูปในทฤษฎีบท 1 ดีกว่าขอบเขตบนแบบเอกรูปในอสมการ (4)

กิตติกรรมประกาศ

ผู้วิจัยขอขอบคุณกรรมการผู้อ่านผลงานวิจัยทั้งสองท่านที่ได้กรุณาให้คำแนะนำและแก้ไขข้อบกพร่องต่างๆ จนทำให้ผลงานวิจัยนี้มีความถูกต้องและสมบูรณ์มากยิ่งขึ้น

เอกสารอ้างอิง

1. Teerapabolarn, K. 2552. A Generalized Binomial Distribution and Relation with the Binomial and Poisson Distributions. *Burapha Science Journal* 14(1): 92-99.
2. Barbour, A. D., Holst, L., and Janson, S. 1992. Poisson Approximation. Oxford Studies in Probability 2. Oxford. Clarendon Press.
3. Chen, L. H. Y. 1975. Poisson Approximation for Dependent Trials. *Annals of Probability* 3: 534-545.
4. Cacoullos, T., and Papathanasiou, V. 1989. Characterization of Distributions by Variance Bounds. *Statistics and Probability Letters* 7: 351-356.
5. Dwass, M. 1979. A Generalized Binomial Distribution. *American Statistician* 33: 86-87.
6. Stein, C. M. 1972. A Bound for the Error in Normal Approximation to the Distribution of a Sum of dependent Random Variables. *Proceedings Sixth Berkeley Symposium on Mathematical Statistics and Probability* 3: 583-602.
7. Stein, C. M. 1986. Approximate Computation of Expectations. Hayward California. IMS.
8. Wongkasem, P., Teerapabolarn K., and Gulasirima, R.. 2008. On Approximating a Generalized Binomial by Binomial and Poisson Distributions. *International Journal of Statistics and Systems* 3: 113-124.

ได้รับบทความวันที่ 5 สิงหาคม 2553

ยอมรับตีพิมพ์วันที่ 21 กันยายน 2553