

Quaderni di Statistica
Vol. 3, 2001

Addendum

Quaderni di Statistica Vol. 2, 2000

On parametric models for invariant probability measures

Patrizia Berti

Dipartimento di Matematica Pura ed Applicata "G. Vitali", Università di Modena

E-mail: berti.patrizia@unimo.it

Sandra Fortini

Istituto di Metodi Quantitativi, Università "L. Bocconi"

E-mail: sandra.fortini@uni-bocconi.it

Lucia Ladelli

Dipartimento di Matematica, Politecnico di Milano

E-mail: lucia.ladelli@mate.polimi.it

Eugenio Regazzini

Dipartimento di Matematica "F. Casorati", Università di Pavia

E-mail: eugenio@dimat.unipv.it

Pietro Rigo

Dipartimento di Statistica "G. Parenti", Università di Firenze

E-mail: rigo@ds.unifi.it

Theorem 7

Let X, T be Polish spaces, P a stationary p.m. on $\mathcal{B}(X^\infty)$, and $\tilde{t} : M_2^* \rightarrow T$ a Borel function. Then, (a₀) is equivalent to (b₀). Moreover, if \tilde{t} is continuous on M_2^* and $\mu(M_2^*) = 1$, then conditions (a₀), (b₀) and (c₀) are equivalent.

Acknowledgements: Research partially supported by: M.U.R.S.T. 40% "Processi Stocastici, Calcolo Stocastico ed Applicazioni".

References

- Burkholder D.L. (1961) Sufficiency in the undominated case, *Annals of Mathematical Statistics*, 32, 1191-1200.
- Fortini S., Ladelli L., Regazzini E. (2000) Exchangeability, predictive distributions and parametric models, *Sankhya*, 62, Series A, 86-109.
- Huber P.J. (1981) *Robust statistics*, J.Wiley, New York.
- Maitra A. (1977) Integral representations of invariant measures, *Transactions of the American Mathematical Society*, 229, 209-225.
- Olshen R. (1974) A note on exchangeable sequences, *Zeitschrift fur Wahrscheinlichkeitstheorie und Verwandte Gebiete*, 28, 317-321.