



Title	正規確率場の共役集合
Author(s)	井上, 和行
Citation	大阪大学, 1986, 博士論文
Version Type	VoR
URL	https://hdl.handle.net/11094/2490
rights	
Note	

The University of Osaka Institutional Knowledge Archive : OUKA

<https://ir.library.osaka-u.ac.jp/>

The University of Osaka

【26】

氏名・(本籍)	いの 井	うえ 上	かず 和	ゆき 行
学位の種類	理	学	博	士
学位記番号	第	7151	号	
学位授与の日付	昭和	61年	3月	18日
学位授与の要件	学位規則第5条第2項該当			
学位論文題目	正規確率場の共役集合			
論文審査委員	(主査) 教 授 池田 信行			
	(副査) 教 授 渡辺 育 教 授 福島 正俊			

論文内容の要旨

関数族 S は積分表現

$$r(t) = ct^2 + \int_0^\infty (1 - e^{-t^2 u}) u^{-1} d\gamma(u) \quad (t \geq 0)$$

および条件 $r(1) = 1$ によって定められる $[0, \infty)$ 上の関数 $r(t)$ の全体として定義される。ただし, c は非負定数で, r は $(0, \infty)$ 上の測度を表わす。 S に属する $r(t)$ および径数空間 \mathbf{R}^d ($d \geq 3$) を指定するとき, 平均 0 の正規確率場 $X = \{X(x); x \in \mathbf{R}^d\}$ で, 条件 $E[(X(x) - X(y))^2] = r(|x-y|)$ に従うものを考えることができるが, これらをすべて同一視して $(X, r(t))$ と記す。この論文では, P. Lévy が多次元径数ブラウン運動の条件付独立性の研究において導入した共役集合の概念を用いることにより, 正規確率場 $(X, r(t))$ の構造が或る種の非退化条件を満たす共役集合の族によって記述できることを示した。 \mathbf{R}^d の空でない部分集合 E に対して, $\{X(z); z \in E\}$ が与えられたときの条件付共分散関数を $R_r(x, y | E)$ とするとき, 共役集合は,

$$F_x(x | E) = \{y \in \mathbf{R}^d; R_r(x, y | E) = 0\}$$

で定義される。ここでは次の条件をみたす組 $\{a, E\}$ を固定しておく。 E は n 個の点 ($n \geq 2$) からなる集合で, その \mathbf{R}^d における直交補空間 $\mathbf{R}^d \ominus E$ の次元は 2 以上とし, 点 a は $\mathbf{R}^d \ominus E$ に属するとする。

主要な結果は次の通りである。 E の点の配置が独立で, 組 $\{a, E, r(t)\}$ が条件

$$(R) \quad a \neq 0 \quad \text{かつ} \quad R_r(a, -a | E) < 0$$

を満たすとき、共役集合 $F_x(a | E)$ は自由度 n をもつ。更に、条件付平均 $E[X(a) | X(z); z \in E]$ の表現に関する或る仮定のもとで次のことが成立つ：(Ⅰ) \mathbf{R}^d 上のもう1つの正規確率場 $(X_1, r_1(t))$ が与えられたとき、 $r_1(t) = r(t)$ である為には、 $F_x(a | E) \subset F_{X_1}(a | E)$ の成立することが必要十分である。(Ⅱ) $r(t)$ が S の部分族 $L = \{r_\alpha(t) = t^\alpha; 0 < \alpha \leq 2\}$ に属す為には、 $F_x(a | E)$ が相似変換に関して不变であること、即ち、等式 $F_x(S_t a | S_t E) = S_t F_x(a | E)$ (t は正数を動く) の成立することが必要十分である。ただし、 $S_t x = tx$ ($x \in \mathbf{R}^d$) とおく。

我々は条件 (R) をみたす組 $\{a, E, r(t)\}$ の典型的な場合を考察した。例えば次のような結果が得られる。 \mathbf{R}^d の次元 d は予め十分に大きくとっておき、

$$E_n = \{a_{nk} = e_{k+1} - \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n e_{j+1}; 1 \leq k \leq n\}$$

とおく。ただし、 n は $2 \leq n \leq d-1$ をみたし、 $\{e_i\}_{1 \leq i \leq d}$ は \mathbf{R}^d の正規直交基底を表わす。このとき、 S に属する任意の $r(t)$ に対して、 n を十分に大きくとれば組 $\{e_1, E_n, r(t)\}$ は条件 (R) を満たす。更に、0 に収束する数列 $\{\alpha_n\}$ ($0 < \alpha_n < 2$) があって、各 $n \geq 2$ と各 α ($\alpha_n < \alpha \leq 2$) に対して、組 $\{e_1, E_n, r_\alpha(t)\}$ は条件 (R) を満たす。

論文の審査結果の要旨

正規確率場の研究は、確率過程論の最も重要な課題のひとつである。とくに典型的な場合は正規確率場 $\{X(x), x \in \mathbf{R}^d\}$ が条件

$$E\{X(x)\} = 0, x \in \mathbf{R}^d, E\{(X(x) - X(y))^2\} = r(|x - y|), x, y \in \mathbf{R}^d$$

$$r(t) = ct^2 + \int_0^\infty (1 - e^{-t^2 u}) u^{-1} r(du), t \geq 0$$

をみたすときであって、数多くの研究が行われている。ただし、 c は非負定数、 r は条件 $\int_0^\infty (1 + u)^{-1} r(du) < \infty$ をみたす $(0, \infty)$ 上の測度で、さらに $r(1) = 1$ がみたされるとする。

本論文において、井上君は、これらの条件がみたされる場合に、正規確率場の構造の解明を、P. Lévy が多次元径数 Brown 運動の条件付独立性の研究のために導入した共役集合の概念を用いて行っている。空でない \mathbf{R}^d の有限部分集合 A に対して $\{X(z), z \in A\}$ が与えられたときの条件付共分散関数を $R(x, y | A)$ 、 $x, y \in \mathbf{R}^d$ とするとき、共役集合 $F(x | A)$ は、

$$F(x | A) = \{y \in \mathbf{R}^d; R(x, y | A) = 0\}$$

で定義される。井上君は $R(x, y | A)$ が $\{X(z), z \in A\}$ の状態で条件をつけた時の $X(x)$ と $X(y)$ の相互の従属性の度合を表わす量であることに着目し、正規確率場の構造がある種の非退化条件をみたす共役集合の族によって記述できることを示している。この事実は巧みな方法である種の関数方程式の性質に帰着して証明されている。これらは P. Lévy の創造的な考えによる成果を大きく発展させるものであり、正規確率場の研究に新たな視点を与えていている。

以上本論文における井上君の研究は正規確率場の研究を発展させ、確率過程論に寄与する所が極めて大きく、理学博士の学位論文として十分価値あるものと認められる。