

5. Арлинский Ю. М., Цекановский Э. Р. О секториальных расширениях положительных эрмитовых операторов и их резольвентах // Докл. АН АрмССР.—1984.— 79, № 5.— С. 199—203.
6. Колманович В. Ю., Маламуд М. М. О расширениях секториальных операторов и дуальных пар сжатий.— Донецк, 1985.— 57 с.— Деп. в ВИНТИ, № 4428-85.

Ворошиловград. машиностроит. ин-т

Получено 08.08.85

УДК 519.21

Е. Б. Баховец

О связи целочисленных марковских мер и мер с независимыми значениями

Понятие марковской меры ввел А. В. Скороход, который получил [1] представление некоторых классов марковских мер.

Пусть (X, \mathfrak{A}) — измеримое пространство, $(\Omega, \mathfrak{E}, P)$ — вероятностное пространство, \mathbb{Z}^+ — множество неотрицательных целых чисел.

Определение 1. Функцию $\mu: \mathfrak{A} \times \Omega \rightarrow \mathbb{Z}^+$ назовем *целочисленной марковской мерой*, если:

- 1) $\forall A \in \mathfrak{A} \mu(A; \cdot)$ является случайной величиной;
- 2) $\mu(\cdot; \omega)$ — конечно-аддитивная мера п. н.;
- 3) $\mu(A_1), \dots, \mu(A_n)$ — цепь Маркова, как только $A_1 \subset A_2 \subset \dots \subset A_n$.

Заметим, что целочисленные меры с независимыми значениями (случайные меры, удовлетворяющие условиям 1 и 2 определения 1 и условию независимости $\mu(A_1), \dots, \mu(A_n)$ для непересекающихся множеств A_1, \dots, A_n из \mathfrak{A}) являются частным случаем марковских мер. В качестве менее тривиального примера марковской меры можно привести случайную целочисленную меру, конечномерные распределения которой удовлетворяют соотношению

$$P\{\mu(A_1) = k_1, \dots, \mu(A_n) = k_n\} = \frac{f^{(k_1)}(A_1; 0)}{k_1!} \dots \frac{f^{(k_n)}(A_n; 0)}{k_n!} \sum_r \varphi^{(k_1 + \dots + k_n + r)}(0) \frac{f^{(r)}\left(\sum_{i=1}^n A_i; 0\right)}{r!}, \quad A_i \cap A_j = \emptyset. \quad (1)$$

Здесь $\varphi(z), f(A; z), A \in \mathfrak{A}$ — семейство аналитических при $|z| < c$ функций, у которых производные всех порядков в нуле неотрицательны, $f(A; 0) = 1$, причем $f(A_1 + A_2; z) = f(A_1; z) f(A_2; z)$, $A_1 \cap A_2 = \emptyset$, и $\sum_k \varphi^{(k)}(0) \frac{f^{(k)}(X; 0)}{k!} = 1$.

В дальнейшем будем считать, что \mathfrak{A} — счетная алгебра, $\mathfrak{A} = \bigcup \mathfrak{A}_n$, \mathfrak{A}_n конечные алгебры с атомами $A_1^n, \dots, A_{r_n}^n$, $\mathfrak{A}_n \subset \mathfrak{A}_{n+1}$.

Определение 2. Целочисленную марковскую меру, для которой $\lim_{n \rightarrow \infty} \max_{1 \leq i \leq r_n} \mu(A_i^n) \leq 1$ с вероятностью 1, будем называть *считающей марковской мерой*.

Целью настоящей работы является получение представления характеристического функционала считающей марковской меры при некоторых дополнительных условиях.

Приведем, прежде всего, некоторые вспомогательные определения и результаты, которые понадобятся в дальнейшем.

Определение 3. Будем говорить, что целочисленная марковская мера μ принадлежит классу M_0 , $\mu \in M_0$, если из того, что

$$P\{\mu(A_1) = k_1, \dots, \mu(A_s) = k_s\} = 0, \quad P\{\mu(A_i) = k_i\} > 0, \\ i = \overline{1, s}, \quad A_i \cap A_j = \emptyset, \quad i \neq j,$$

следует $P\{\mu(\sum_{i=1}^s A_i) = k_1 + \dots + k_s\} = 0$.

Очевидно, что мера μ , распределения которой задаются (1), принадлежит классу M_0 .

Лемма 1. Если \mathfrak{A} — алгебра, порожденная конечным разбиением $\mathcal{D} = (A_1, \dots, A_n)$ множества X , $\nu \in M_0$, $\nu(A_i) \leq 1$, $0 < P\{\nu(A_i) = 1\} < 1$, $i = \overline{1, n}$, то для $(a_1, \dots, a_n) \in \{0, 1\}^n$

$$P\{\nu(A_1) = a_1, \dots, \nu(A_n) = a_n\} = P\{\nu(X) = r\} \times \\ \times \frac{\alpha_1^{a_1} \dots \alpha_n^{a_n}}{\sum_{1 \leq i_1 < i_2 < \dots < i_r \leq n} \alpha_{i_1} \dots \alpha_{i_r}}, \quad (2)$$

где $r = \sum_{i=1}^n a_i$, $\alpha_i = P\{\nu(A_i) = 1, \nu(X - A_i) = 0\}$, $i = \overline{1, n}$.

Доказательство см. в работе [2].

Пусть $\mu_n: \mathfrak{A}_n \times \Omega \rightarrow \mathbb{Z}^+$ — марковские меры вида (1), $\mu_n(A_i^n) \leq 1$, $i = \overline{1, r_n}$, $n = 1, 2, \dots$. т. е. для $B_1, \dots, B_s \in \mathfrak{A}_n$, $B_i \cap B_j = \emptyset$

$$P\{\mu_n(B_1) = l_1, \dots, \mu_n(B_s) = l_s\} = \frac{f_n^{(l_1)}(B_1; 0)}{l_1!} \dots \frac{f_n^{(l_s)}(B_s; 0)}{l_s!} \times \\ \times \sum_r \varphi_n^{(r+l_1+\dots+l_s)}(0) \frac{f_n^{(r)}(\sum_{i=1}^s B_i; 0)}{r!}, \quad f_n^{(m)}(A_i^n; 0) = 0, \quad m \geq 2, \\ i = \overline{1, r_n}, \quad n = 1, 2, \dots$$

Будем говорить, что последовательность μ_n удовлетворяет условию S_1 , если существует счетное число непересекающихся множеств E_1, \dots, E_s, \dots , $\sum E_i = X$, что $\lim_n P\{\mu_n(E_i) = 1, \mu_n(X - E_i) = 0\} > 0$, $i = 1, 2, \dots$

Теорема 1 [2]. Для сходимости распределений $\mu_n(B_1), \dots, \mu_n(B_s)$, $B_i \in \mathfrak{A}$, $i = \overline{1, s}$, к некоторому предельному распределению при выполнении условия S_1 необходимо, а при выполнении условия $\lim_n P\{\mu_n(X) = 1\} > 0$ достаточно существования пределов

$$\lim_n P\{\mu_n(X) = k\} = b_k, \quad \sum_k b_k = 1, \quad \lim_n \sum_{A_j^n \subset A} P^l\{\mu_n(A_j^n) = 1, \\ \mu_n(X - A_j^n) = 0\} = m_l(A), \quad \forall A \in \mathfrak{A}$$

для таких l , что $\sum_l b_l > 0$. В этом случае предельное распределение является распределением марковской меры вида (1) с

$$f(A; z) = \exp\left(\sum_{i=1}^{\infty} \frac{(-1)^{i-1}}{i} m_i(A) z^i\right), \quad \varphi(z) = \sum_k \frac{b_k}{f^{(k)}(X; 0)} z^k.$$

Рассмотрим марковскую меру ν , заданную на конечной алгебре \mathfrak{B} с

атомами B_1, \dots, B_n , $\nu(B_i) \leq 1$, $i = \overline{1, n}$. Обозначим

$$\alpha_i = P\{\nu(B_i) = 1, \nu(X - B_i) = 0\}, \quad i = \overline{1, n};$$

$$I = \{i : \alpha_i > 0\} \equiv \{i_1, \dots, i_s\}; \quad \beta_i = P\{\nu(X) = i\}, \quad i = \overline{1, n};$$

$$\tilde{P}_{j_1 \dots j_l} = P\{\nu(B_{j_1}) = 1, \dots, \nu(B_{j_l}) = 1, \nu(X - \sum_1^l B_{j_k}) = 0\}.$$

Лемма 2.

$$\tilde{P}_{j_1 \dots j_l} = \beta_l \frac{\alpha_{j_1} \dots \alpha_{j_l}}{\sum_{\{k_1 \dots k_l\} \subset \{1, \dots, n\}} \alpha_{k_1} \dots \alpha_{k_l}}, \quad l \leq s. \quad (3)$$

Доказательство. Покажем сначала, что $\tilde{P}_{j_1 \dots j_l} > 0$, $l \leq s$, тогда и только тогда, когда $\{j_1 \dots j_l\} \subset I$, $\beta_l > 0$. Доказательство необходимости проведем индукцией по l . При $l = 1$ утверждение следует из определения 1. Пусть оно верно для k , $\beta_k > 0$ и $\beta_{k+1} = \dots = \beta_{k+p-1} = 0$, $\beta_{k+p} > 0$, $k + p \leq s$. Предположим, что $\tilde{P}_{j_1 \dots j_{k+p}} > 0$, $j_{k+p} \in I$. Выбирая $i_m \in I$, $i_m \in \overline{\{j_1 \dots j_{k+p}\}}$ и приравнявая условные вероятности

$$P\left\{\nu(X) = k + p / \nu\left(X - \sum_1^{k+p-1} B_{j_l}\right) = 1, \nu(B_{j_{k+p}}) = 1\right\},$$

$$P\left\{\nu(X) = k + p / \nu\left(X - \sum_1^{k+p-1} B_{j_l}\right) = 1, \nu(B_{i_m}) = 1\right\},$$

закключаем, что

$$\frac{\tilde{P}_{j_1 \dots j_{k+p}}}{\sum_{l=0}^{k+p-1} \sum_{\{k_1 \dots k_l\} \subset \{j_1 \dots j_{k+p-1}\}} \tilde{P}_{k_1 \dots k_l j_{k+p}}} = \frac{\tilde{P}_{j_1 \dots j_{k+p-1} i_m}}{\sum_{l=0}^{k+p-1} \sum_{\{k_1 \dots k_l\} \subset \{j_1 \dots j_{k+p-1}\}} \tilde{P}_{k_1 \dots k_l i_m}}.$$

Отсюда согласно предположению индукции следует $1 \leq \frac{\tilde{P}_{j_1 \dots j_{k+p-1} i_m}}{\tilde{P}_{j_1 \dots j_{k+p-1} i_m} + \alpha_{i_m}}$, хотя $\alpha_{i_m} > 0$. Что касается достаточности, то при $\{j_1 \dots j_{l-1}, k, m\} \subset I$, $\beta_l > 0$, $l \leq s$, справедливо соотношение

$$\frac{\tilde{P}_{j_1 \dots j_{l-1} k}}{\alpha_k + \sum_{m=0}^{l-1} \sum_{\{r_1 \dots r_m\} \subset \{j_1 \dots j_{l-1}\}} \tilde{P}_{r_1 \dots r_m k}} = \frac{\tilde{P}_{j_1 \dots j_{l-1} m}}{\alpha_m + \sum_{n=0}^{l-1} \sum_{\{r_1 \dots r_n\} \subset \{j_1 \dots j_{l-1}\}} \tilde{P}_{r_1 \dots r_n m}},$$

а значит, вероятности $\tilde{P}_{j_1 \dots j_{l-1} k}$, $\tilde{P}_{j_1 \dots j_{l-1} m}$ либо положительны, либо обращаются в 0 одновременно, что и доказывает утверждение.

Рассмотрим сужение меры ν на $X' = \bigcup_{j=1}^s B_{i_j}$, т. е. случайную меру ν' на $(X', \mathfrak{B} \cap X')$, распределения которой

$$\tilde{P}'_{j_1 \dots j_l} \equiv P\{\nu'(B_{i_{j_1}}) = 1, \dots, \nu'(B_{i_{j_l}}) = 1, \nu'(X' - \sum_{k=1}^l B_{i_{j_k}}) = 0\} =$$

$$= P\{\nu(B_{i_{j_1}}) = 1, \dots, \nu(B_{i_{j_l}}) = 1, \nu(X - \sum_{k=1}^l B_{i_{j_k}}) = 0\}, \quad l \leq s,$$

$$P\{\nu'(X') = 0\} = 1 - \sum_1^s \beta_{i_j}.$$

Мера ν' на X' принадлежит классу M_0 , поэтому из леммы 1 следует

$$\bar{P}'_{i_1 \dots i_l} = \frac{\alpha_{i_1} \dots \alpha_{i_l}}{\sum_{\{k_1 \dots k_l\} \subset \{1 \dots s\}} \alpha_{i_{k_1}} \dots \alpha_{i_{k_l}}} P\{\nu'(X') = l\}, \quad 0 < l \leq s,$$

$$\{j_1 \dots j_l\} \subset \{1 \dots s\},$$

что влечет (3).

Будем говорить, что мера μ удовлетворяет условию S , если существует счетное число непересекающихся множеств E_i , $E_i \in \mathfrak{A}$, $\cup E_i = X$, что $P\{\mu(E_i) = 1, \mu(X - E_i) = 0\} > 0$, $i = 1, 2, \dots$. Введем следующие обозначения:

$$\alpha_{i,n} = P\{\mu(A_i^n) = 1, \mu(X - A_i^n) = 0\}, \quad i = \overline{1, r_n};$$

$$I_n(A) = \{i: A_i^n \subset A\}, \quad A \in \mathfrak{A}_n; \quad \sigma_{i,n}(A) = \sum_{\{j_1 \dots j_i\} \subset I_n(A)} \alpha_{j_1,n} \dots \alpha_{j_i,n}, \quad i = \overline{1, r_n}.$$

Справедлива следующая теорема.

Теорема 2. *Конечномерные распределения марковской считающей меры μ , удовлетворяющей условию S , представимы в виде (1) и $\mu \in M_0$.*

Доказательство. Пусть $A_i \cap A_j = \emptyset$, $i \neq j$, $\sum_1^l A_i = X$, $A_i \in \mathfrak{A}$.

Поскольку μ — считающая марковская мера, то

$$P\{\mu(A_1) = k_1, \dots, \mu(A_l) = k_l\} =$$

$$= \lim_n P\{\mu(A_1) = k_1, \dots, \mu(A_l) = k_l, \max_i \mu(A_i^n) \leq 1\} =$$

$$= \lim_n P\{\mu_n(A_1) = k_1, \dots, \mu_n(A_l) = k_l\}.$$

Здесь μ_n — целочисленная марковская мера, заданная на (X, \mathfrak{A}_n) , $\max_i \mu_n(A_i^n) \leq 1$, $P\{\mu_n(A_1^n) = a_1, \dots, \mu_n(A_{r_n}^n) = a_{r_n}\} = P\{\mu(A_1^n) = a_1, \dots, \mu(A_{r_n}^n) = a_{r_n}\}$, $(a_1, \dots, a_n) \in \{0, 1\}^{r_n}$, $\sum_1^{r_n} a_i < r_n$.

В силу условия S при достаточно больших n среди $\alpha_{i,n}$, $i = \overline{1, r_n}$, будет не менее $k_1 + \dots + k_l$ положительных, поэтому согласно лемме 2 при достаточно больших n в случае $\sum_1^{r_n} a_i \leq k_1 + \dots + k_l$

$$P\{\mu_n(A_1^n) = a_1, \dots, \mu_n(A_{r_n}^n) = a_{r_n}\} = P\{\mu_n(X) = \sum_1^{r_n} a_i\} \times$$

$$\times \frac{\alpha_{1,n}^{a_1} \dots \alpha_{r_n,n}^{a_{r_n}}}{\sum_1^{\sum a_i} \sigma_{r_n}(X)}.$$

Следовательно,

$$P\{\mu_n(A_1) = k_1, \dots, \mu_n(A_l) = k_l\} = P\{\mu_n(X) = k_1 + \dots + k_l\} \times$$

$$\times \frac{\sigma_{k_1,n}(A_1) \dots \sigma_{k_l,n}(A_l)}{\sigma_{k_1 + \dots + k_l,n}(X)}.$$

Рассмотрим последовательность «усеченных» мер $\tilde{\mu}_n$, заданных на (X, \mathfrak{A}_n) , $n = 1, 2, \dots$, таких, что $P\{\tilde{\mu}_n(A_1^n) = a_1, \dots, \tilde{\mu}_n(A_{r_n}^n) = a_{r_n}\} = P\{\mu_n(A_1^n) =$

$= a_1, \dots, \mu_n(A_n^{r_n}) = a_{r_n}$, если $0 < \sum_1^{r_n} a_i \leq k_1 + \dots + k_i$; $P\{\tilde{\mu}_n(X) = k\} = 0$,

если $k > k_1 + \dots + k_i$; $P\{\tilde{\mu}_n(X) = 0\} = 1 - \sum_1^{k_1 + \dots + k_i} P\{\mu_n(X) = i\} \equiv \tilde{\beta}_{0,n}$. Меры $\tilde{\mu}_n$

при достаточно больших n являются марковскими мерами с конечномерными распределениями

$$P\{\tilde{\mu}_n(B_1) = l_1, \dots, \tilde{\mu}_n(B_s) = l_s\} = \frac{f_n^{(l_1)}(B_1; 0)}{l_1!} \dots \frac{f_n^{(l_s)}(B_s; 0)}{l_s!} \times \\ \times \sum_r \varphi_n^{(l_1 + \dots + l_s + r)}(0) \frac{f_n^{(r)}\left(\sum_1^s B_i; 0\right)}{r!}, \quad n = 1, 2, \dots; B_1, \dots, B_s \in \mathfrak{A}_n, \\ B_i \cap B_j = \emptyset, i \neq j,$$

где $f_n(A; z) = \prod_{i \in I_n(A)} (\alpha_{i,n} z + 1)$, $\varphi_n(z) = \sum_{j=1}^{k_1 + \dots + k_i} \frac{P\{\mu_n(X) = j\}}{\sigma_{i,n}(X) j!} z^j + \tilde{\beta}_{0,n}$, при-

чем меры $\tilde{\mu}_n$ удовлетворяют для достаточно больших n условиям теоремы 1. Поскольку $\lim_n P\{\tilde{\mu}_n(B_1) = l_1, \dots, \tilde{\mu}_n(B_s) = l_s\} = P\{\mu(B_1) = l_1, \dots,$

$\dots, \mu(B_s) = l_s\}$, для $B_i \in \mathfrak{A}$, $\sum_1^s B_i = X$, $0 < l_1 + \dots + l_s \leq k_1 + \dots + k_i$,

$\lim_n \tilde{\beta}_{0,n} = 1 - \sum_{j=1}^{k_1 + \dots + k_i} P\{\mu(X) = j\}$, а значит, распределения $\tilde{\mu}_n(B_1), \dots, \tilde{\mu}_n(B_s)$

сходятся к некоторому предельному распределению, то существуют пределы

$$\lim_n \sum_{i \in I_n(A)} \alpha_{i,n}^s = m_s(A) \quad \forall A \in \mathfrak{A}, s \leq k_1 + \dots + k_s. \quad (4)$$

В силу произвольности выбора $k_1 + \dots + k_i$ заключаем, что пределы вида

$$4) \text{ существуют для всех таких } s, \text{ что } \sum_{k=s}^{\infty} P\{\mu(X) = k\} > 0.$$

Воспользовавшись достаточными условиями теоремы 1, получим

$$P\{\mu(A_1) = k_1, \dots, \mu(A_s) = k_s\} = \frac{f^{(k_1)}(A_1; 0)}{k_1!} \dots \frac{f^{(k_s)}(A_s; 0)}{k_s!} \times \\ \times \sum_r \varphi^{(k_1 + \dots + k_s + r)}(0) \frac{f^{(r)}\left(\sum_1^s A_i; 0\right)}{r!}, \quad (5)$$

$$\text{где } f(A; z) = \exp\left(\sum_{i=1}^{\infty} \frac{(-1)^{i-1}}{i} m_i(A) z^i\right), \quad \varphi(z) = \sum_i \frac{P\{\mu(X) = j\}}{j^i(X; 0)} z^i.$$

Говорят, что последовательность $(A_{i(n)}^n)$ фундаментальна относительно (\mathfrak{A}_n) , если $A_{i(n)}^n \supset A_{i(n+1)}^{n+1} \forall n$. Случайная мера μ называется стохастически непрерывной относительно (\mathfrak{A}_n) , если для всякой фундаментальной последовательности $\mu(A_{i(n)}^n) \xrightarrow{n} 0$ с вероятностью 1.

Следствие 1. Если $P\{\mu(X) = 1\} > 0$ и μ — стохастически непрерывная марковская считающая мера, то ее конечномерные распределения представимы в виде (4), (5).

Доказательство. Поскольку число положительных $\alpha_{i,n}$ не убывает, то либо $\forall k$ можно указать N такое, что число положительных $\alpha_{i,n}$ больше k при $n \geq N$ (это эквивалентно выполнению условия S), либо для достаточно больших n число положительных $\alpha_{i,n}$ величина постоянная. В этом случае существует конечное число фундаментальных последовательностей $(A_{i_1(n)}^n, \dots, (A_{i_p(n)}^n))$, что $\alpha_{i_j,n} > 0 \forall n, j = \overline{1, p}$, и $P\{\mu(X) = 1\} = \sum_{j=1}^p \alpha_{i_j,n}$, но $\alpha_{i,n} \leq P\{\mu(A_i^n) = 1\}$, и, следовательно, $P\{\mu(X) = 1\} = 0$.

Таким образом, стохастически непрерывная марковская считающая мера с $P\{\mu(X) = 1\} > 0$ удовлетворяет условиям теоремы 2.

Пусть мера $\tilde{\mu}$ на (X, \mathfrak{A}) является целочисленной мерой с независимыми значениями и производящая функция случайной величины $\tilde{\mu}(A)$ есть

$$\exp\left\{\sum_{i=1}^{\infty} \frac{(-1)^{i-1}}{i} m_i(A) z^i\right\} \exp\left\{-\sum_{i=1}^{\infty} \frac{(-1)^{i-1}}{i} m_i(A)\right\}. \quad (6)$$

Тогда распределения меры μ можно представить в виде

$$P\{\mu(A_1) = k_1, \dots, \mu(A_l) = k_l\} = \prod_{i=1}^l P\{\tilde{\mu}(A_i) = k_i\} \sum_r \frac{P\{\mu(X) = r + k_1 + \dots + k_l\}}{P\{\tilde{\mu}(X) = r + k_1 + \dots + k_l\}} P\left\{\tilde{\mu}\left(X - \sum_1^l A_i\right) = r\right\}.$$

Рассмотрим характеристический функционал меры μ $X_\mu(g)$. Пусть $g(z) = \sum_1^l g_i I_{A_i}(z)$, $A_i \in \mathfrak{A}$. Тогда с учетом (6)

$$X_\mu(g) = \sum_{k=0}^{\infty} P\{\mu(X) = k\} M\{e^{\int g(z) d\tilde{\mu}(z)} / \mu(X) = k\}. \quad (7)$$

Таким образом, справедливо следующее утверждение.

С л е д с т в и е 2. *Характеристический функционал марковской считающей меры μ , удовлетворяющей условию S , представим в виде (6), (7).*

1. Скороход А. В. Несколько замечаний о случайных мерах // Вестн. Киев. ун-та. Сер. астроном., мат. и мех.— 1958.— Вып. 1.— С. 105—114.
2. Бахоуец Е. Б. Об одном классе целочисленных марковских мер // Случайные процессы. Теория и практика.— Киев: Ин-т математики АН УССР, 1985.— С. 3—14.

Киев. ун-т

Получено 16.12.85

УДК 517.53

А. П. Г о л у б

О совместных аппроксимациях Паде набора вырожденных гипергеометрических функций

1. Введение. Приведем необходимые сведения и определения.

Определение 1 (см., например, [1]). Пусть $F = \{f_k(z)\}_{k=1}^n$ — набор аналитических в окрестности точки $z = 0$ функций, а $\vec{r} = (r_1, \dots, r_n)$ — вектор, координатами которого являются неотрицательные целые числа, сумма которых равна некоторому числу $N = N(\vec{r}) \in \mathbb{N}^1$. Совместными аппроксимациями Паде набора функций $\{f_k(z)\}_{k=1}^n$ порядка $([N/N]; \vec{r})$ на-