

今後の研究計画

星野 浄生

2022年12月28日

乱関数に関する微積分に関し、以下の研究を行う。

(1) Ogawa 積分可能性

[5] では、適当な Skorokhod 積分過程 X の Brown 運動 B に関する Ogawa 積分 $\int_0^t X(s) d_\varphi B_s$ が、各 $t \in [0, L]$ に対して収束することを示した。この収束は、因果的な場合は $t \in [0, L]$ に関して一様である (従って X は正則可積分と呼ばれる条件を満たす) ことが [7] で分かっている、正則可積分な乱関数で定まる確率積分方程式の解の一意存在性が [8] で与えられている。そこで、一般の場合に、 X の正則可積分性を調べる。また、[6, Theorem 7.3] で示された Nualart-Pardoux-Stratonovich 積分 (NPS 積分) 可能な乱関数の Ogawa 積分可能性や、時間パラメータ t の空間 $[0, L]$ を一般化した場合の Ogawa 積分可能性についても調べる。

(2) 確率積分の Riemann 近似

正則化 Riemann 和 $R_\Delta(X; Y)$ (X, Y は乱関数, Δ は $[0, T]$ の重み付き分割) を導入し, R_Δ に基づく以下の 2 性質を持つ確率積分 $I_\alpha(X; Y) = \int X d_\alpha Y$ (α は区間 $[0, T]$ から $[0, 1]$ への可測関数) を構成した ([3]).

(a) Y が Brown 運動 B で $\alpha = \frac{1}{2}$ の場合, I_α は正則 CONS に関する Ogawa 積分や NPS 積分を近似する。

(b) Y が連続 semi-martingale で $\alpha = \frac{1}{2}$ の場合, I_α は Y に関する Fisk-Stratonovich 積分を近似する。

さらに, Y を Brown 運動としたとき, Ogawa 積分を定義する CONS φ に関して「全ての Brownian quasi-martingale が φ -可積分であること」と「 φ が正則であること」が同値であるという Ogawa 積分に関する基本的事実が [7] で示されているが, その類比として, Y を連続 quasi-martingale としたとき, 「全ての quasi-martingale に対し I_α が存在する」ための重み付き分割 Δ に関する必要十分条件を与えた。

Ogawa 積分は Brown 運動に関して定義される一方, [3] で与えた積分 I_α は quasi-martingale に関して定義され, (a) の意味で正則基底に関する Ogawa 積分を含む積分となる。そこで, [9] で与えられているような Ogawa 積分に関する積分可能性やその応用に関する事実と同様の事が, (連続或いは不連続な) quasi-martingale に関する積分 I_α に関しても言えるかという問題を研究する。

(3) 確率微分可能性, 乱関数の SFC による同定

確率微分や 2 次変分は確率積分の逆演算に相当する基本的な演算であるが, 一般に, 2 次変分をもつ乱関数 X, Y の和は 2 次変分をもつとは限らない。本研究では, 2 次変分をもつ乱関数の一般的な線形空間や代数を与えることで, 確率積分の理論に依らず, 確率積分の逆に相当する確率微分や 2 次変分の計算が統一的にできることを示す。

[2], [4] で (大まかに) 次の定理を得ている: V を 2 次変分をもつ乱関数としたとき, 2 次変分 $[\]$ と V に関する確率微分 $\frac{d}{dV}$ が存在する乱関数のクラス

$$Q(V) = \left\{ X : \text{乱関数} \left| [X], \frac{dX}{dV} \text{ が存在し, } \frac{d[X]}{d[V]} = \left| \frac{dX}{dV} \right|^2 \right. \right\}$$

は線形空間をなす。尚, この結果は, 「これまでの研究成果のまとめ」に記載した乱関数の SFC による同定に関する結果 [1] の証明に用いられる。

次に, $Q(V)$ が環となっているかを調べたり, 2 次変分をもつ乱関数の線形空間で $Q(V)$ よりも広いものを与える事を目指す。また, この研究の乱関数の SFC による同定問題への応用を試みる。

参考文献

- [1] K. Hoshino, Identification of random functions from the SFCs defined by the Ogawa integral regarding regular CONSs (Probability Symposium), RIMS Kôkyûroku. **2116**, 95-104, (2019).
- [2] K. Hoshino, Stochastic differentiability, Ogawa integrability and identification from SFCs of random functions, doctoral thesis, Osaka prefecture university, (2020)
- [3] K. Hoshino, On a Riemann approximation of the stochastic integral, MSJ Spring Meeting, abstract, (2020).
- [4] K. Hoshino, On the stochastic differentiability with respect to the process with quadratic variation, preprint, submitted to Stochastics.
- [5] K. Hoshino, T. Kazumi, On the Ogawa integrability of noncausal Wiener functionals, Stochastics. Vol. 91. **5**, 773-796, (2019).
- [6] D. Nualart, E. Pardoux, Stochastic calculus with anticipating integrands. Probab. Th. Rel. Fields, **78**, pp.535-581, (1988).
- [7] S. Ogawa, The stochastic integral of noncausal type as an extension of the symmetric integrals, Japan J. Appl. Math. **2**, 229-240, (1985).
- [8] S. Ogawa, On a stochastic Fourier transformation, Stochastics. Vol. 85. **2**, 286-294, (2013).
- [9] S. Ogawa, Noncausal Stochastic Calculus. Springer, (2017).