

2020年度 東京大学大学院

数理科学研究科 数理科学専攻 修士課程

## 専門科目B (筆記試験)

2019年 8月 27日 (火)

11:00 ~ 15:00

問題は全部で18題ある。その中から**3題**選んで解答すること。

- (1) 解答しようとする各問ごとに解答用紙を1枚使用すること。  
各解答用紙の所定欄に各自の**氏名**, **受験番号**と解答する**問題の番号**を記入すること。
- (2) 各計算用紙の上部に各自の**受験番号**を明記すること。ただし氏名は記入してはならない。
- (3) 試験終了後に提出するものは、1題につき1枚、計**3枚の答案**、および**3枚の計算用紙**である。着手した問題数が3題にみたない場合でも、氏名と受験番号のみを記入した白紙答案を補い、3枚とすること。  
指示に反したもの、**答案が3枚でないものは無効**とする。
- (4) 解答用紙の裏面を使用する場合は、表面右下に「裏面使用」と明記すること。

### B 第1問

$F = \mathbf{C}(S, T)$ ,  $K = \mathbf{R}(S^2, \frac{T^2}{1+S})$  とおき,  $F$  の  $K$  上の Galois 閉包を  $L$  とする.

- (1)  $L$  の  $K$  上の拡大次数  $[L : K]$  を求めよ.
- (2)  $L$  の部分体で  $K$  の 8 次拡大になっているものの個数を求めよ.
- (3)  $L$  の部分体であって,  $K$  の Galois 拡大ではない 8 次拡大になっており, かつ  $\mathbf{C}$  を含まないものの例をあげよ.

### B 第2問

以下の間に答えよ.

- (1)  $K$  を体とする.  $K$  上の 2 変数多項式環  $K[X, Y]$  の極大イデアルは 2 つの元で生成されることを示せ.
- (2) 有理整数環  $\mathbf{Z}$  上の 2 変数多項式環  $\mathbf{Z}[X, Y]$  の極大イデアルは 3 つの元で生成されることを示せ.

### B 第3問

$X, Y$  を変数とする複素数体  $\mathbf{C}$  上の 2 変数多項式環の商環  $\mathbf{C}[X, Y]/(Y^3 - X^4 - X^3)$  を  $R$  で表し,  $X, Y$  の  $R$  における像を  $x, y$  で表す.  $x$  と  $y$  で生成される  $R$  のイデアルを  $I$  とする. また  $\mathbf{C}$  代数  $S$  を  $S = \bigoplus_{n=0}^{\infty} I^n / I^{n+1}$  で定める. ただし,  $S$  の加法群の構造は加法群  $I^n / I^{n+1}$  ( $n \geq 0$ ) の直和で与え, 積は

$$(a + I^{n+1})(b + I^{m+1}) = (ab + I^{n+m+1}) \quad (a \in I^n, b \in I^m, n \geq 0, m \geq 0)$$

で定める. また  $S$  の  $\mathbf{C}$  代数の構造は自然な同一視  $\mathbf{C} = I^0 / I^1$  によって与える.

- (1)  $I/I^2, I^2/I^3$  の  $\mathbf{C}$  上のベクトル空間としての次元を求めよ.
- (2)  $x, y$  の  $I/I^2$  での像を  $\bar{x}, \bar{y}$  で表す.  $U, V$  を変数とする  $\mathbf{C}$  上の 2 変数多項式環  $\mathbf{C}[U, V]$  からの  $\mathbf{C}$  代数の準同型  $F: \mathbf{C}[U, V] \rightarrow S$  を  $F(U) = \bar{x}, F(V) = \bar{y}$  で定める.  $\text{Ker } F$  の生成元を求めよ.
- (3)  $\mathbf{C}$  代数  $R$  と  $S$  は同型ではないことを示せ.

### B 第4問

$\mathbf{F}_3$  を 3 元体とし, 正の整数  $n$  に対し,  $S_n$  は  $n$  次対称群を表す.

- (1) 群環  $\mathbf{F}_3[S_2]$  の素イデアルの個数を求めよ.
- (2)  $R = \mathbf{F}_3[S_3]$  とし,  $R$  の中心を  $A$  とする.  $A$  の素イデアルの個数を求めよ.
- (3)  $A$  のべき零根基を  $I$  とし, 環  $R \otimes_A (A/I)$  の全ての極大左イデアルの共通部分を  $J$  とする.  $J$  の  $\mathbf{F}_3$  上のベクトル空間としての次元を求めよ.

### B 第5問

$\mathbf{R}^2$  の標準的な座標を  $(x, y)$  とし, 単位円周  $S^1$  に  $\mathbf{R}^2$  の部分多様体の構造を入れる.

$\alpha \in \mathbf{R}$  に対して,  $\mathbf{R}^2$  上のベクトル場  $X_\alpha$  を

$$X_\alpha(x, y) = x \frac{\partial}{\partial x} + \alpha y \frac{\partial}{\partial y}$$

により定める. また, 関数の和とスカラー倍により

$$V_\alpha = \{f : \mathbf{R}^2 \rightarrow \mathbf{R} \mid f \text{ は } C^\infty \text{ 級であって, } X_\alpha f = 0 \text{ が成り立つ}\},$$

$$W_\alpha = \{f : \mathbf{R}^2 \setminus \{(0, 0)\} \rightarrow \mathbf{R} \mid f \text{ は } C^\infty \text{ 級であって, } X_\alpha f = 0 \text{ が成り立つ}\},$$

$$Z = \{g : S^1 \rightarrow \mathbf{R} \mid g \text{ は } C^\infty \text{ 級である}\}$$

に実線型空間の構造を入れる. ただし,  $X_\alpha f$  は, ベクトル場  $X_\alpha$  による関数  $f$  の微分を表す. 以下の間に答えよ.

- (1)  $\alpha > 0$  とする.  $W_\alpha$  と  $Z$  の間の線型同型写像を一つ構成せよ.
- (2)  $\alpha > 0$  ならば  $V_\alpha$  は有限次元であることを示せ.
- (3)  $\alpha < 0$  ならば  $V_\alpha$  は有限次元でないことを示せ.

B 第6問

2次の実正方行列全体の集合  $M_2(\mathbf{R})$  に標準的な  $\mathbf{R}^4$  の位相を入れる。その部分集合  $G$  を

$$G = \left\{ \begin{pmatrix} x & y \\ 0 & x \end{pmatrix} \mid x, y \in \mathbf{R}, x > 0 \right\}$$

で定め、 $G$  に  $\mathbf{R}^4$  の部分多様体の構造を入れる。行列の積によって  $G$  に群の構造を入れ、 $G$  の  $G$  自身への左作用を、 $A \in G$  に対して

$$\varphi_A : G \longrightarrow G, \quad \varphi_A(X) = AX$$

によって定める。 $G$  の部分群  $\Gamma$  を

$$\Gamma = \left\{ \begin{pmatrix} e^m & ne^m \\ 0 & e^m \end{pmatrix} \mid m, n \in \mathbf{Z} \right\}$$

で定める。以下の間に答えよ。

- (1)  $\Gamma$  の左作用による  $G$  の商空間  $M = G/\Gamma$  は、射影  $\pi : G \longrightarrow M$  が  $C^\infty$  級写像となるような  $C^\infty$  級多様体の構造を持ち、トーラス  $S^1 \times S^1$  と微分同相となることを示せ。
- (2)  $G$  上の 1 次微分形式  $\omega$  で、すべての  $A \in G$  に対して

$$\varphi_A^* \omega = \omega$$

を満たすものの全体のなす  $\mathbf{R}$  上の線型空間を  $V$  とおく。 $V$  の次元を求め、その基底を一組与えよ。

- (3)  $G$  上の 2 次微分形式

$$\sigma = \frac{dx \wedge dy}{x^2}$$

は  $\Gamma$  の左作用で不変であり、商空間  $M = G/\Gamma$  上の 2 次微分形式を定めることを示せ。また、 $M$  に向きを一つ与え、積分

$$\int_M \sigma$$

を計算せよ。

B 第7問

ユークリッド空間  $\mathbf{R}^4 = \mathbf{R}^2 \times \mathbf{R}^2$  の標準座標を  $(x, y)$ ,  $x = (x_1, x_2)$ ,  $y = (y_1, y_2)$  とし,  $\mathbf{R}^4$  上の 2 次微分形式  $\omega$  を

$$\omega = dx_1 \wedge dy_1 + dx_2 \wedge dy_2$$

と定める. 以下の間に答えよ.

(1)  $\mathbf{R}^4$  上の  $C^\infty$  級関数  $f$  および  $C^\infty$  級ベクトル場  $X, Y$  あって,

$$i_X \omega = df, \quad \mathcal{L}_Y \omega = 0, \quad Yf = 0$$

を満たすものが与えられたとする. ただし,  $i$  は内部積,  $\mathcal{L}$  はリー微分を表し,  $Yf$  はベクトル場  $Y$  による関数  $f$  の微分を表す. このとき,  $\mathbf{R}^4$  上の  $C^\infty$  級関数  $g$  で, 条件

$$i_Y \omega = dg$$

を満たすものが存在することを示せ. さらに,

$$Xg = 0, \quad [X, Y] = 0$$

が成り立つことを確かめよ.

(2)  $\mathbf{R}^2$  上の  $C^\infty$  級関数  $\phi$  に対して,  $\mathbf{R}^4$  上の関数  $f_\phi$  を次のように定める.

$$f_\phi(x, y) = e^{-2\phi(x_1, x_2)}(y_1^2 + y_2^2).$$

このとき,  $\mathbf{R}^4$  上の  $C^\infty$  級ベクトル場  $X$  で

$$i_X \omega = df_\phi$$

を満たすものを関数  $\phi$  および  $\phi$  の偏導関数を用いて表せ.

また,  $\mathcal{L}_Y \omega = 0$  を満たす自明でない  $C^\infty$  級ベクトル場  $Y$  で, 次の条件を満たすものを考える.

(条件)  $x_1$  軸に沿った平行移動で不变な全ての  $\phi$  に対して  $Yf_\phi = 0$  となる.

そのようなベクトル場  $Y$  を一つ求め, それに対して  $i_Y \omega = dg$  となる  $C^\infty$  級関数  $g$  を求めよ.

B 第 8 問

ユークリッド空間  $\mathbf{R}^3$  の 3 つの元の組  $(p_1, p_2, p_3) \in (\mathbf{R}^3)^3$  で、条件

$$p_i \cdot p_j = \begin{cases} 1 & (i = j) \\ -\frac{1}{2} & (i \neq j) \end{cases}$$

を満たすものの全体の集合  $X$  をユークリッド空間  $(\mathbf{R}^3)^3 = \mathbf{R}^9$  の部分位相空間とみなす。

ただし、記号  $\cdot$  は  $\mathbf{R}^3$  の標準的な内積を表す。また、

$$(p_1, p_2, p_3) \sim (p_2, p_3, p_1)$$

で生成された同値関係による  $X$  の商空間を  $Y \doteq X/\sim$  とおく。以下の間に答えよ。

(1)  $X$  から 2 次元単位球面  $S^2$  への写像  $\mu: X \rightarrow S^2$  を

$$\mu(p_1, p_2, p_3) = \frac{p_1 \times p_2}{\|p_1 \times p_2\|}$$

によって定めると、 $\mu$  は商空間  $Y$  からの写像  $\nu: Y \rightarrow S^2$  を誘導する。ただし、記号  $\times$  は  $\mathbf{R}^3$  の外積

$$\begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} \times \begin{pmatrix} d \\ e \\ f \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} bf - ce \\ cd - af \\ ae - bd \end{pmatrix}$$

を表し、 $\|\cdot\|$  は  $\mathbf{R}^3$  の標準的なノルムを表す。このとき、

$$Y_0 = \left\{ y \in Y \mid \nu(y) \neq \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix} \right\}$$

は単位円周  $S^1$  とホモトピー同値であることを示せ。

(2)  $Y$  の整係数ホモロジ一群を求めよ。

### B 第9問

$\mathbf{R}$  の有界開集合  $\Omega$  上のルベーグ可積分な関数の列  $\{f_n\}$  およびルベーグ可積分な関数  $f$  を考える。ルベーグ可測集合  $E$  に対して  $|E|$  はそのルベーグ測度を表す。以下の間に答えよ。

(1) 任意の正数  $\varepsilon$  に対して、次の性質 (A) を満たす正数  $\delta$  が存在することを示せ。

(A)  $|E| < \delta$  を満たす  $\Omega$  内の任意のルベーグ可測集合  $E$  に対して

$$\left| \int_E f(x) dx \right| < \varepsilon \text{ が成立する。}$$

(2)  $\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\Omega} |f_n(x) - f(x)| dx = 0$  が成立したとする。このとき、任意の正数  $\varepsilon$  に対して、次の性質 (B) を満たす正数  $\delta$  が存在することを示せ。

(B)  $|E| < \delta$  を満たす  $\Omega$  内の任意のルベーグ可測集合  $E$  に対して

$$\left| \int_E f_n(x) dx \right| < \varepsilon \text{ が全ての } n = 1, 2, \dots \text{ に対して成立する。}$$

(3)  $\Omega$  上全ての点  $x$  において  $\lim_{n \rightarrow \infty} f_n(x) = f(x)$  が成立したとする。さらに任意の正数  $\varepsilon$  に対して、上記の性質 (B) を満たす正数  $\delta$  が存在したとする。このとき

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_{\Omega} |f_n(x) - f(x)| dx = 0$$

が成立することを示せ。

### B 第10問

$\mathbf{C}$  上の有理型関数  $h(z)$  と  $\mathbf{C}$  の点  $a$  に対して  $\text{Res}(h(z), a)$  は  $a$  における  $h(z)$  の留数を表す。

(1)  $P(z)$  と  $Q(z)$  は多項式で、 $\deg P + 2 \leq \deg Q$  を満たすとする。有理関数  $f(z) = P(z)/Q(z)$  の極の集合を  $S = \{a_1, a_2, \dots, a_N\}$  とおくとき次を示せ。

$$\sum_{n \in \mathbf{Z} \setminus S} f(n) = - \sum_{k=1}^N \text{Res} \left( \frac{\pi f(z)}{\tan \pi z}, a_k \right).$$

(2) 次を示せ。

$$\frac{\pi}{\tan \pi z} = \frac{1}{z} + \sum_{n \in \mathbf{Z} \setminus \{0\}} \left( \frac{1}{z-n} + \frac{1}{n} \right).$$

B 第 11 問

$\varepsilon > 0$  に対して, 実数値関数  $Y_\varepsilon(x)$  を

$$Y_\varepsilon(x) = xe^{-\varepsilon|x|}$$

とおき,  $\mathbf{R}$  上の関数  $h_\varepsilon(y)$  を

$$h_\varepsilon(y) = \int_{-\infty}^{\infty} Y_\varepsilon(x) e^{ixy} dx$$

で定義する. 以下の間に答えよ.

- (1)  $h_\varepsilon(y)$  を計算せよ.
- (2) 台が有界な  $\mathbf{R}$  上の  $C^2$  級関数  $g(y)$  に対して

$$\lim_{\varepsilon \rightarrow +0} \int_{-\infty}^{\infty} h_\varepsilon(y) g(y) dy$$

を求めよ.

B 第 12 問

正規直交基底  $\{e_n\}_{n=0}^{\infty}$  を持つ  $\mathbf{C}$  上のヒルベルト空間  $H$  を考える.  $\{\theta_n\}_{n=0}^{\infty}$  を  $[0, \pi/2]$  に値を持つ数列とする.  $H$  内の単位ベクトルの列  $\{x_n\}_{n=0}^{\infty}, \{y_n\}_{n=0}^{\infty}$  を

$$\begin{cases} x_n = e_{2n}, \\ y_n = (\cos \theta_n) e_{2n} + (\sin \theta_n) e_{2n+1} \end{cases}$$

により定める.  $X$  を  $\{x_n\}_{n=0}^{\infty}$  の張る閉部分空間,  $Y$  を  $\{y_n\}_{n=0}^{\infty}$  の張る閉部分空間とする. 以下の間に答えよ.

- (1) 次の不等式を示せ.

$$\sqrt{2} \left( 1 - \sup_n \cos \theta_n \right)^{1/2} \leq \inf \left\{ \|x - y\| \mid x \in X, y \in Y, \|x\| = 1, \|y\| = 1 \right\}.$$

- (2)  $\sup_n \cos \theta_n < 1$  の時,  $X + Y$  は閉であることを示せ.

B 第 13 問

$t \geq 0$  において、次の連立線型常微分方程式の解を考える。

$$\begin{cases} \frac{d\eta_1(t)}{dt} = c_1(t)\eta_1(t) + c_2(t)\eta_2(t), \\ \frac{d\eta_2(t)}{dt} = (c_2(t) + \gamma)\eta_1(t) - c_1(t)\eta_2(t). \end{cases}$$

ここで、 $c_1(t), c_2(t)$  は実数値連続関数で、 $\gamma$  は実定数である。 $t = 0$  で初期値  $(\eta_1(0), \eta_2(0))$  を与える。

このとき以下の間に答えよ。

(1)  $c_1, c_2$  が定数である場合、任意の初期値に対して、

$$\sup_{t>0}(|\eta_1(t)| + |\eta_2(t)|) < \infty$$

となるための必要十分条件を求めよ。

(2)  $\gamma > 0$  である場合を考える。実数  $\alpha > 0, \beta > 0$  が  $\alpha - \beta > \gamma (> 0)$  を満たすとする。 $c_1(t), c_2(t)$  が  $t \geq 0$  に対して  $c_1(t) \geq \alpha, |c_2(t)| \leq \beta$  を満たし、初期値が次を満たすものとする。

$$\eta_1(0) > |\eta_2(0)|.$$

このとき任意の  $t > 0$  に対して

$$\eta_1(t) > |\eta_2(t)|$$

が成り立つことを示せ。

また、

$$\eta_1(t) \geq e^{(\alpha-\beta)t} \eta_1(0)$$

となることを示せ。

B 第 14 問

(1) 次の行列の固有値を全て求めよ.

$$\begin{pmatrix} 2 & -1 & 0 & 0 \\ -1 & 2 & -1 & 0 \\ 0 & -1 & 2 & -1 \\ 0 & 0 & -1 & 2 \end{pmatrix}.$$

(2)  $a, \tau$  を正の実数,  $N$  を正の整数として,  $2\tau(N+1)^2 \leq 1 + a\tau$  を仮定する.

$\{u_{j,n}\}_{0 \leq j \leq N+1, 0 \leq n}$  が次の差分方程式を満たすとする.

$$\frac{u_{j,n+1} - u_{j,n}}{\tau} = (N+1)^2(u_{j-1,n} - 2u_{j,n} + u_{j+1,n}) + au_{j,n} \quad (1 \leq j \leq N, n \geq 0).$$

ただし,  $n \geq 0$  に対して,  $u_{0,n} = u_{N+1,n} = 0$  とする.

このとき, 任意の正数  $T$  に対して,  $a$  と  $T$  にのみ依存する正の定数  $C$  が存在して,

$$\max_{n\tau \leq T} \sum_{j=1}^N u_{j,n}^2 \leq C \sum_{j=1}^N u_{j,0}^2$$

が成立することを証明せよ.

B 第 15 問

非負の整数  $n$  に対し, 多項式  $p_n(x)$  を次のように定める.

$$p_0(x) = 1, \quad p_n(x) = \left( x - \frac{1}{2} \frac{d}{dx} \right)^n \cdot 1 \quad (n \geq 1).$$

以下の間に答えよ.

(1) 次の積分を求めよ.

$$\int_{-\infty}^{+\infty} p_n(x)p_m(x) e^{-x^2} dx \quad (n, m \geq 0).$$

(2) 次の積分を  $p_n(x)$  を用いて表せ.

$$I_n = \frac{1}{2\pi i} \oint_{\Gamma} \frac{e^{x^2 - z^2}}{(z - x)^{n+1}} dz$$

ただし,  $\Gamma$  は, 複素平面上の閉曲線  $|z - x| = r$  ( $r > 0$ ) を反時計回りに一周する積分路とする.

(3) 多項式列  $\{p_n(x)\}_{n \geq 0}$  を生成する母関数  $G(x, t) = \sum_{n=0}^{\infty} p_n(x) \frac{t^n}{n!}$  を求めよ.

(4) 次の恒等式を示せ.

$$p_n(x+y) = \sum_{\substack{j, k, \ell \geq 0 \\ j+k+2\ell=n}} \frac{1}{4^\ell} \frac{n!}{j! k! \ell!} p_j(x) p_k(y).$$

### B 第 16 問

$\mathbf{R}^3$  の単位球面を  $S$  とする. 以下の手順に従い,  $S$  上のラプラシアン  $\Delta$  の固有関数を求めよう. ただし,  $\Delta$  は  $S$  上の滑かな複素数値関数に作用するものとする. また, 極座標  $x = \sin \theta \cos \phi$ ,  $y = \sin \theta \sin \phi$ ,  $z = \cos \theta$  を用いると,  $\Delta$  の関数  $f$  への作用が

$$\Delta f = \frac{1}{\sin \theta} \frac{\partial}{\partial \theta} \left( \sin \theta \frac{\partial f}{\partial \theta} \right) + \frac{1}{\sin^2 \theta} \frac{\partial^2 f}{\partial \phi^2}$$

と表示されることを用いて良い.

(1) 微分方程式

$$\frac{d}{dw} \left( (1 - w^2) \frac{dP(w)}{dw} \right) + \lambda P(w) = 0$$

が  $w$  の多項式を解として持つための  $\lambda$  に対する条件を求めよ. また, そのときの解  $P(w)$  を具体的に求めよ.

(2) (1) で求めた条件の下で微分方程式

$$\frac{d}{dw} \left( (1 - w^2) \frac{dP^{(m)}(w)}{dw} \right) + \left( \lambda - \frac{m^2}{1 - w^2} \right) P^{(m)}(w) = 0$$

の解  $P^{(m)}(w)$  を  $P(w)$  を用いて表せ. ただし,  $m$  は整数とする.

(3) 上の結果を用いて, ラプラシアンの固有関数を極座標表示で求めよ.

## B 第 17 問

自然数の集合  $\mathbf{N} = \{0, 1, 2, \dots\}$  の部分集合  $A$  が極限計算可能であるとは、計算可能関数  $f : \mathbf{N}^2 \rightarrow \mathbf{N}$  が存在して、任意の  $i$  について、 $i \in A$  ならば  $\lim_{n \rightarrow \infty} f(n, i) = 1$  となり、 $i \notin A$  ならば  $\lim_{n \rightarrow \infty} f(n, i) = 0$  となることをいう。ここで  $\lim_{n \rightarrow \infty} f(n, i) = c$  とは  $\exists n_0 \forall n \geq n_0 [f(n, i) = c]$  となることを表す。このとき以下の間に答えよ。

- (1) 計算可能な無限木  $T \subset {}^{<\omega}\{0, 1\}$  に対し、極限計算可能な集合  $A$  で

$$\forall n \in \mathbf{N}[(\chi_A(0), \dots, \chi_A(n)) \in T]$$

となるものが存在することを示せ。ここで  $\chi_A$  は  $A$  の特徴関数を表し、 ${}^{<\omega}\{0, 1\}$  は 0 か 1 を成分にもつ有限列全体の集合を表す。

- (2) 可算個の命題変数  $\{p_i\}_{i \in \mathbf{N}}$  から論理結合子  $\neg, \vee$  によって作られる論理式を考える。論理式の集合  $\Gamma$  の元は、ある計算可能関数  $n \mapsto [\varphi_n]$  によって枚挙されているとする。すなわち  $\Gamma = \{\varphi_n \mid n \in \mathbf{N}\}$  とする。ここで  $[\varphi] \in \mathbf{N}$  は論理式  $\varphi$  のゲーデル数を表す。さらに  $\Gamma$  は有限充足可能であるとする。このとき、 $\Gamma$  を充足する真理値割当  $\nu : p_i \mapsto \nu(p_i) \in \{0, 1\}$  として極限計算可能なものが取れることを示せ。ここで、写像  $\nu : p_i \mapsto \nu(p_i) \in \{0, 1\}$  を集合  $\{i \in \mathbf{N} \mid \nu(p_i) = 1\}$  と同一視している。また論理式  $\varphi$  について  $\nu(\varphi) \in \{0, 1\}$  は、 $\nu(\neg\varphi) = 1 - \nu(\varphi)$ ,  $\nu(\varphi \vee \theta) = \max\{\nu(\varphi), \nu(\theta)\}$  によって再帰的に定義されている。

### B 第 18 問

非負整数の集合を  $\mathbf{N} = \{0, 1, 2, \dots\}$  とし、正整数の集合を  $\mathbf{Z}_{>0} = \{1, 2, \dots\}$  とする。

$\{Z_n\}_{n \in \mathbf{Z}_{>0}}$  を実数に値をとる独立確率変数列で

$$E[Z_n] = 1, \quad E[Z_n^2] = v \quad (n \in \mathbf{Z}_{>0})$$

を満たすとする。ここで  $v$  は定数である。確率変数列  $\{X_n\}_{n \in \mathbf{N}}$  を次のように定める。

$$X_0 = 0, \quad X_n = (\theta X_{n-1} + 1) Z_n \quad (n \in \mathbf{Z}_{>0}).$$

ここで、 $\theta \in \mathbf{R}$  は  $0 < |\theta| < v^{-1/2}$  を満たす定数である。このとき、以下の間に答えよ。

- (1)  $v \geq 1$  であることを示せ。
- (2)  $n \in \mathbf{Z}_{>0}$  に対して  $X_n$  の期待値  $E[X_n]$  を求めよ。
- (3)  $m, n \in \mathbf{Z}_{>0}$  に対して、 $X_m$  と  $X_n$  の共分散を  $\text{Cov}[X_m, X_n]$  で表す。 $v$  と  $\theta$  に依存する定数  $C$  が存在して、不等式

$$|\text{Cov}[X_m, X_n]| \leq C|\theta|^{|n-m|}$$

がすべての  $m, n \in \mathbf{Z}_{>0}$  に対して成り立つことを示せ。

- (4)  $M_n$  を

$$M_n = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n X_j$$

とし、 $T_n$  を

$$T_n = \begin{cases} 1 - \frac{1}{M_n} & (M_n \neq 0 \text{ のとき}) \\ 0 & (M_n = 0 \text{ のとき}) \end{cases}$$

とする。このとき、 $T_n$  が確率収束することを示せ。