

Bernstein 関数

1

定義 1.1. (Bernstein 関数). $F : \mathbb{R}_{\geq 0} \rightarrow \mathbb{R}_{\geq 0}$ は, 非負の実数 $a, b \geq 0$ と測度 μ で

$$\int_0^\infty \frac{\lambda}{1+\lambda} d\mu(\lambda) < \infty$$

を満たすもので,

$$F(x) := a + bx + \int_0^\infty (1 - e^{-\lambda x}) d\mu(\lambda)$$

を満たすものが存在する時, Bernstein 関数という.