

# 固有値・固有ベクトルの応用 2

数理工学 第8回

小林 健 / Ken Kobayashi

東京科学大 工学院 経営工学系

2025年10月30日

# 目次

① 1 階線形微分方程式系と行列指数関数

② Richardson の軍拡モデル

③ 都市の人口移動モデル

# 目次

① 1 階線形微分方程式系と行列指数関数

② Richardson の軍拡モデル

③ 都市の人口移動モデル

# 1 階の線形微分方程式

- 実数  $t \in \mathbb{R}$  を変数とする関数  $y = f(t)$  の 1 階の導関数を  $y' = \frac{df}{dt}$  と表す.
- 関数  $y: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  が次の方程式 (微分方程式) を満たすものとする:

$$y' = ay \quad (a \in \mathbb{R} \text{ は定数}).$$

- この微分方程式を満たす関数は

$$y = e^{at} \cdot C \quad (C \in \mathbb{R} \text{ は任意の定数})$$

という形で表される (解の導出は以降の授業で扱う).

- 特に  $f(0) = y_0$  とすると, 上の式に代入して  $C = y_0$  であり

$$y = e^{at} \cdot y_0.$$

ポイント

1 階線形微分方程式の解は指数関数で表される

# 1 階の線形微分方程式系

考えること 複数本の方程式からなる 1 階の線形微分方程式「系」の解を求める

- $n$  個の未知関数  $y_1 = f_1(t), y_2 = f_2(t), \dots, y_n = f_n(t)$  に関する微分方程式系:

$$\underbrace{\begin{pmatrix} y'_1 \\ y'_2 \\ \vdots \\ y'_n \end{pmatrix}}_{y'} = \underbrace{\begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nn} \end{pmatrix}}_{=:A \text{ (定数行列)}} \underbrace{\begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_n \end{pmatrix}}_y$$

- $t = 0$  における関数值 (初期値)  $\mathbf{y}_0 = (f_1(0), f_2(0), \dots, f_n(0))^T$  が所与のとき、この線形方程式系の解は次のように書ける:

$$\mathbf{y} = e^{At} \mathbf{y}_0.$$

ここで  $e^{At}$  は行列指数関数 (後述) である。

# 正方形行列の指數関数

- マクローリン展開から、スカラー  $a$  を変数とする指數関数  $e^a$  で次が成立:

$$e^a = 1 + a + \frac{1}{2!}a^2 + \frac{1}{3!}a^3 + \dots$$

～ これに基づいて指數関数の定義を拡張する

## 定義 (行列指數関数)

適當なサイズの正方形行列  $A$  に対して、行列指數関数  $e^A$  を次のように定義する:

$$e^A := I + A + \frac{1}{2!}A^2 + \frac{1}{3!}A^3 + \dots$$

注意 右辺の無限級数は任意の正方形行列  $A$  に対して収束する (証明は略).

# 行列指数関数の性質

## 行列指数関数に関する性質

- $e^O = I$  ( $O$  はゼロ行列).
- 任意の正方行列  $A$  に対して  $e^A$  は正則行列.
- 2 つの正方行列  $A, B$  に対して,  $AB = BA$  のとき  $e^{A+B} = e^A e^B$ .
- 任意の正方行列  $A$  に対して,  $(e^A)^{-1} = e^{-A}$ .

スカラーの場合の指数関数と同様の性質が成り立つことがポイント (証明は省略).

## 微分に関する性質

$t \in \mathbb{R}$  を変数とする関数  $e^{At}$  を考える. このとき,

$$\begin{aligned}\frac{d}{dt} e^{At} &= \frac{d}{dt} \left( I + At + \frac{1}{2!} A^2 t^2 + \frac{1}{3!} A^3 t^3 + \dots \right) = A + A^2 t + \frac{1}{2!} A^3 t^2 + \dots \\ &= A \left( I + At + \frac{1}{2!} A^2 t^2 + \frac{1}{3!} A^3 t^3 + \dots \right) = Ae^{At}.\end{aligned}$$

# 行列指数関数の計算

正方行列が対角化可能ならば行列指数関数は簡単に計算できる

- 正方行列  $A$  が正則行列  $P$  と対角行列  $\Lambda$  を用いて

$$A = P\Lambda P^{-1}.$$

と表されるとする。

- このとき、 $e^A$  を定義に従って計算すると

$$e^A = I + A + \frac{1}{2!}A^2 + \frac{1}{3!}A^3 + \dots$$

$$= I + P\Lambda P^{-1} + \frac{1}{2!}P\Lambda^2 P^{-1} + \frac{1}{3!}P\Lambda^3 P^{-1} + \dots \quad (\because A^k = P\Lambda^k P^{-1})$$

$$= P\left(I + \Lambda + \frac{1}{2!}\Lambda^2 + \frac{1}{3!}\Lambda^3 + \dots\right)P^{-1}$$

$$= Pe^{\Lambda}P^{-1}.$$

- 対角行列  $\Lambda$  を  $\Lambda = \begin{pmatrix} \lambda_1 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n \end{pmatrix}$  と表すと  $\Lambda^k = \begin{pmatrix} \lambda_1^k & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \lambda_n^k \end{pmatrix}$ .

- よって  $e^\Lambda$  は次のように計算できる:

$$e^\Lambda = \begin{pmatrix} \sum_{k=0}^{\infty} \frac{\lambda_1^k}{k!} & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \sum_{k=0}^{\infty} \frac{\lambda_n^k}{k!} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} e^{\lambda_1} & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & e^{\lambda_n} \end{pmatrix}.$$

- 以上から,  $e^A$  は次のように表される:

$$e^A = P \begin{pmatrix} e^{\lambda_1} & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & e^{\lambda_n} \end{pmatrix} P^{-1}.$$

# 行列指数関数を用いた線形微分方程式系の求解

次の 1 階の線形微分方程式系の解を求めたい:

$$\mathbf{y}' = A\mathbf{y} \quad (A \in \mathbb{R}^{n \times n} \text{ は定数行列}) \quad (1)$$

- $\mathbf{c} \in \mathbb{R}^n$  を任意の定数ベクトルとして  $\boxed{\mathbf{y} = e^{At}\mathbf{c}} \cdots (*)$  とする.
- $\frac{d}{dt}e^{At} = Ae^{At}$  より,

$$\mathbf{y}' = Ae^{At}\mathbf{c} = A\mathbf{y}.$$

ゆえに  $(*)$  は微分方程式系 (1) の解である.

- また  $t = 0$  のとき  $e^{A \cdot 0} \mathbf{c} = \mathbf{c}$  なので, 初期値が  $\mathbf{y}_0 \in \mathbb{R}^n$  と与えられているとき, その解は

$$\mathbf{y} = e^{At}\mathbf{y}_0$$

と表される (実はこれが唯一の解でもある).

- $A = P\Lambda P^{-1}$  と対角化可能な場合 ( $P$  は正則行列,  $\Lambda$  は対角行列),  
線形微分方程式系の解は次のように書ける:

$$\mathbf{y} = e^{At} \mathbf{y}_0 = Pe^{\Lambda t} P^{-1} \mathbf{y}_0$$

- ここで

$$P := (\mathbf{p}_1, \mathbf{p}_2, \dots, \mathbf{p}_n), \quad \mathbf{c} = \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \\ \vdots \\ c_n \end{pmatrix} := P^{-1} \mathbf{y}_0$$

とすると、微分方程式系の解は次のように書き直せる:

$$\mathbf{y} = (\mathbf{p}_1, \mathbf{p}_2, \dots, \mathbf{p}_n) \begin{pmatrix} e^{\lambda_1 t} & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & e^{\lambda_n t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \\ \vdots \\ c_n \end{pmatrix} = \mathbf{p}_1 e^{\lambda_1 t} c_1 + \mathbf{p}_2 e^{\lambda_2 t} c_2 + \cdots + \mathbf{p}_n e^{\lambda_n t} c_n.$$

# 目次

① 1階線形微分方程式系と行列指数関数

② Richardson の軍拡モデル

③ 都市の人口移動モデル

# 1 階の線形微分方程式系の例

## Richardson の軍拡モデル

- 対立する 2 国 (A 国と B 国) に対し、時刻  $t$  におけるそれぞれの軍事力を次で表す：

$$y_1(t) = \text{A 国の軍事力},$$

$$y_2(t) = \text{B 国の軍事力}$$

- 軍事力の変化を記述する微分方程式系

$$y'_1(t) = k y_2(t) - \alpha y_1(t),$$

$$y'_2(t) = \ell y_1(t) - \beta y_2(t)$$

$k, \ell > 0 \dots$  防衛係数 (相手国の軍事力に対する反応度合い)

$\alpha, \beta > 0 \dots$  疲弊率 (自国の軍事力に伴って発生する社会・経済の疲弊)

- 行列とベクトルを次のように定義する:

$$\mathbf{y}(t) = \begin{pmatrix} \mathbf{y}_1(t) \\ \mathbf{y}_2(t) \end{pmatrix}, \quad \mathbf{y}'(t) = \begin{pmatrix} \mathbf{y}'_1(t) \\ \mathbf{y}'_2(t) \end{pmatrix} \quad A = \begin{pmatrix} -\alpha & k \\ \ell & -\beta \end{pmatrix}.$$

- 先の微分方程式系は

$$\begin{cases} \mathbf{y}'_1(t) = -\alpha \mathbf{y}_1(t) + k \mathbf{y}_2(t) \\ \mathbf{y}'_2(t) = \ell \mathbf{y}_1(t) - \beta \mathbf{y}_2(t) \end{cases} \iff \mathbf{y}'(t) = A \mathbf{y}(t)$$

と書け、その解は

$$\mathbf{y}(t) = e^{At} \mathbf{y}_0$$

と表される。ここで  $\mathbf{y}_0 = \begin{pmatrix} \mathbf{y}_1(0) \\ \mathbf{y}_2(0) \end{pmatrix}$  は初期の軍事力を並べたベクトル。

⇒ 行列  $A$  によって  $\mathbf{y}(t)$  の振る舞いはどのように変わるか?

## 軍拡モデルの数値例 (1/3)

$$A = \begin{pmatrix} -4 & 4 \\ 2 & -2 \end{pmatrix}, \quad \mathbf{y}_0 = \begin{pmatrix} 120 \\ 180 \end{pmatrix} \text{ の場合}$$

$$\begin{cases} y'_1(t) = -4y_1(t) + 4y_2(t), & y_1(0) = 120, \\ y'_2(t) = +2y_1(t) - 2y_2(t), & y_2(0) = 180 \end{cases}$$

- 行列  $A$  は次のように対角化可能:

$$\begin{pmatrix} -4 & 4 \\ 2 & -2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & -2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & -6 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & -2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}^{-1}.$$

- よって,  $\mathbf{y}(t)$  は

$$\mathbf{y}(t) = e^{At} \mathbf{y}_0 = \begin{pmatrix} 1 & -2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{0 \cdot t} & 0 \\ 0 & e^{-6 \cdot t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & -2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}^{-1} \begin{pmatrix} 120 \\ 180 \end{pmatrix}.$$

- 右辺を計算すると

$$\begin{aligned} \mathbf{y}(t) &= \begin{pmatrix} 1 & -2 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{0 \cdot t} & 0 \\ 0 & e^{-6t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 160 \\ 20 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} \cdot 160 + \begin{pmatrix} -2 \\ 1 \end{pmatrix} \cdot 20e^{-6t} \\ &\rightarrow \begin{pmatrix} 160 \\ 160 \end{pmatrix} \quad (t \rightarrow \infty). \end{aligned}$$

~~~ 両国の軍事力は等しい値に収束

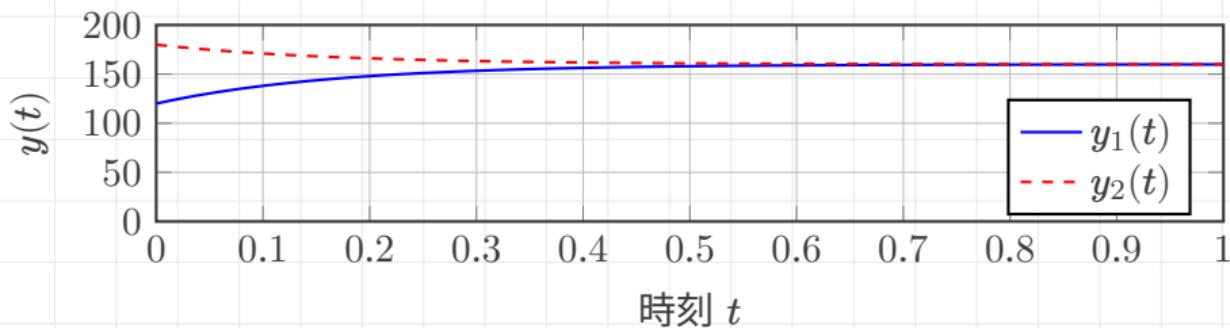


Figure:  $y_1(t)$  と  $y_2(t)$  の時間変化

## 数値例 (2/3) 防衛係数が大きい場合 (敵対度が強い場合)

$$A = \begin{pmatrix} -4 & 8 \\ 3 & -2 \end{pmatrix}, \quad \mathbf{y}_0 = \begin{pmatrix} 120 \\ 180 \end{pmatrix} \text{ の場合}$$

$$\begin{cases} y'_1(t) = -4y_1(t) + 8y_2(t), & y_1(0) = 120, \\ y'_2(t) = +3y_1(t) - 2y_2(t), & y_2(0) = 180 \end{cases}$$

- 行列  $A$  は次のように対角化可能:

$$\begin{pmatrix} -4 & 8 \\ 3 & -2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 4 & 2 \\ 3 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & -8 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 4 & 2 \\ 3 & -1 \end{pmatrix}^{-1}.$$

- よって,  $\mathbf{y}(t)$  は

$$\mathbf{y}(t) = e^{At} \mathbf{y}_0 = \begin{pmatrix} 4 & 2 \\ 3 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{2t} & 0 \\ 0 & e^{-8t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 4 & 2 \\ 3 & -1 \end{pmatrix}^{-1} \begin{pmatrix} 120 \\ 180 \end{pmatrix}.$$

- したがって、

$$\begin{aligned} \mathbf{y}(t) &= \begin{pmatrix} 4 & 2 \\ 3 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{2t} & 0 \\ 0 & e^{-8t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 48 \\ -36 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 4 \\ 3 \end{pmatrix} \cdot 48e^{2t} + \begin{pmatrix} 2 \\ -1 \end{pmatrix} \cdot (-36)e^{-8t} \\ &\rightarrow \begin{pmatrix} \infty \\ \infty \end{pmatrix} \quad (t \rightarrow \infty). \end{aligned}$$

~~~ 両国の軍事力は正の無限大に発散

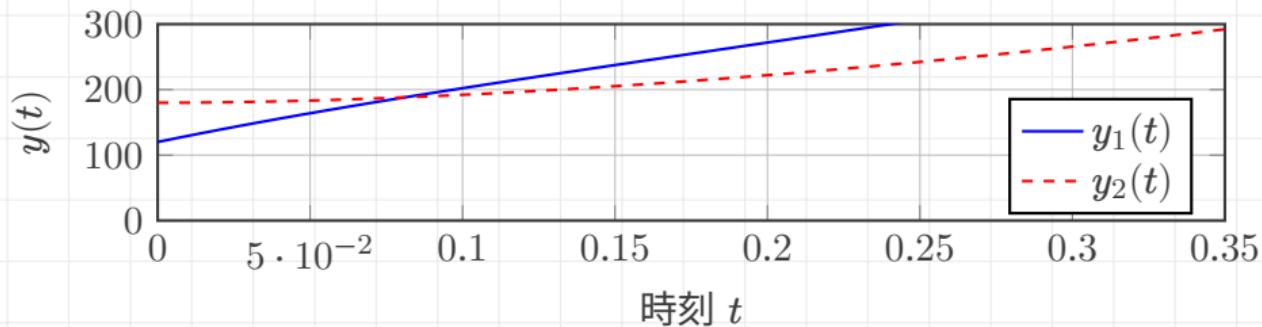


Figure:  $y_1(t)$  と  $y_2(t)$  の時間変化

## 数値例 (3/3) 防衛係数が小さい場合 (敵対度が弱い場合)

$$A = \begin{pmatrix} -4 & 3 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}, \quad \mathbf{y}_0 = \begin{pmatrix} 120 \\ 180 \end{pmatrix} \text{ の場合}$$

$$\begin{cases} y'_1(t) = -4y_1(t) + 3y_2(t), & y_1(0) = 120, \\ y'_2(t) = +1y_1(t) - 2y_2(t), & y_2(0) = 180 \end{cases}$$

- 行列  $A$  は次のように対角化可能:

$$\begin{pmatrix} -4 & 3 \\ 1 & -2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -3 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -5 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -3 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}^{-1}$$

- よって  $\mathbf{y}(t)$  は

$$\begin{aligned} \mathbf{y}(t) &= e^{At} \mathbf{y}_0 = \begin{pmatrix} -3 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{-5t} & 0 \\ 0 & e^{-1t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -3 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}^{-1} \begin{pmatrix} 120 \\ 180 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} -3 \\ 1 \end{pmatrix} \cdot 15e^{-5t} + \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} \cdot 165e^{-1 \cdot t} \rightarrow \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix} \quad (t \rightarrow \infty) \quad (\text{計算過程省略}). \end{aligned}$$

~~~ 両国の軍事力はゼロに収束

# 解の安定性

## 線形微分方程式系

$$\mathbf{y}' = A\mathbf{y} \quad (A \in \mathbb{R}^{n \times n} \text{ は定数行列})$$

疑問：微分方程式の解  $\mathbf{y}(t)$  は発散するのか、収束するのか？

～～  $A$  の固有値を調べるとわかる

### 固有値を用いた解の安定性の判定

行列  $A$  の固有値の実部が

- すべて負のとき  $\rightarrow \mathbf{y}(t)$  はゼロベクトルに収束
- すべて 0 以下のとき  $\rightarrow \mathbf{y}(t)$  は有界
- それ以外  $\rightarrow \mathbf{y}(t)$  は無限大に発散

# 目次

① 1 階線形微分方程式系と行列指數関数

② Richardson の軍拡モデル

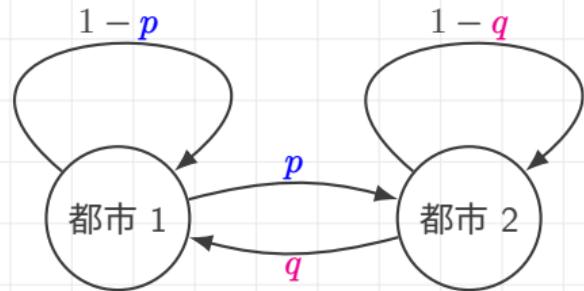
③ 都市の人口移動モデル

## 2 都市間での人口の移動のモデル化

- 毎年、都市 1 から都市 2 へ割合  $p \in (0, 1)$  で人口が移動し、  
都市 2 から都市 1 へ割合  $q \in (0, 1)$  で人口が移動すると仮定。
- 現在の 2 都市の人口を  $x_1^0, x_2^0 \geq 0$  とする。
- このとき、1 年後の人口  $x_1^1, x_2^1$  は

$$\begin{pmatrix} x_1^1 \\ x_2^1 \end{pmatrix} = \underbrace{\begin{pmatrix} 1-p & q \\ p & 1-q \end{pmatrix}}_{=A \text{ とおく}} \begin{pmatrix} x_1^0 \\ x_2^0 \end{pmatrix}$$

と表される。



～～ 将来、2 都市の人口はどのような値になるか？

- 現在の人口と  $k$  年後の人口をそれぞれ

$$\boldsymbol{x}^0 = \begin{pmatrix} x_1^0 \\ x_2^0 \end{pmatrix}, \quad \boldsymbol{x}^k = \begin{pmatrix} x_1^k \\ x_2^k \end{pmatrix}$$

とする.

- このとき,  $k$  年後の人口は

$$\boldsymbol{x}^k = A^k \boldsymbol{x}^0$$

と表される.

$\rightsquigarrow \lim_{k \rightarrow \infty} \boldsymbol{x}^k$  はどのような値になるか?

- 行列  $A$  の固有値を計算すると  $\lambda_1 = 1, \lambda_2 = 1 - \textcolor{blue}{p} - \textcolor{pink}{q}$ .
- それぞれに対応する固有ベクトルは

$$\begin{pmatrix} \textcolor{pink}{q} \\ \textcolor{blue}{p} \end{pmatrix}, \quad \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \end{pmatrix}$$

で, これらは線形独立. よって  $A$  は対角化可能.

- $Q = \begin{pmatrix} \textcolor{red}{q} & 1 \\ \textcolor{blue}{p} & -1 \end{pmatrix}$  として  $A = Q \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 - \textcolor{blue}{p} - \textcolor{red}{q} \end{pmatrix} Q^{-1}$  と対角化する。このとき

$$\begin{aligned}\lim_{k \rightarrow \infty} A^k &= Q \left( \lim_{k \rightarrow \infty} \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & (1 - \textcolor{blue}{p} - \textcolor{red}{q})^k \end{pmatrix} \right) Q^{-1} \\ &= Q \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} Q^{-1} \quad (\because |1 - \textcolor{blue}{p} - \textcolor{red}{q}| < 1).\end{aligned}$$

- よって、

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \mathbf{x}^k = \lim_{k \rightarrow \infty} A^k \begin{pmatrix} x_1^0 \\ x_2^0 \end{pmatrix} = \underbrace{\begin{pmatrix} \textcolor{red}{q} & 1 \\ \textcolor{blue}{p} & -1 \end{pmatrix}}_Q \underbrace{\begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \left\{ \frac{1}{\textcolor{blue}{p} + \textcolor{red}{q}} \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ \textcolor{blue}{p} & -\textcolor{red}{q} \end{pmatrix} \right\}}_{Q^{-1}} \begin{pmatrix} x_1^0 \\ x_2^0 \end{pmatrix} = \frac{x_1^0 + x_2^0}{\textcolor{blue}{p} + \textcolor{red}{q}} \begin{pmatrix} \textcolor{red}{q} \\ \textcolor{blue}{p} \end{pmatrix}$$

- したがって 2 都市の人口の比は  $\textcolor{red}{q} : \textcolor{blue}{p}$  に収束し、  
 $\lambda_1 = 1$  に対応する固有ベクトルの成分の比率と一致する。

# $n$ 個の都市間での人口の移動のモデル化

- 毎年、都市  $j$  から都市  $i$  へ割合  $a_{ij}$  で人口が移動すると仮定

ただし、 $a_{ij} \geq 0$  ( $i, j = 1, 2, \dots, n$ ) であり、 $\sum_{i=1}^n a_{ij} = 1$  ( $j = 1, 2, \dots, n$ ).

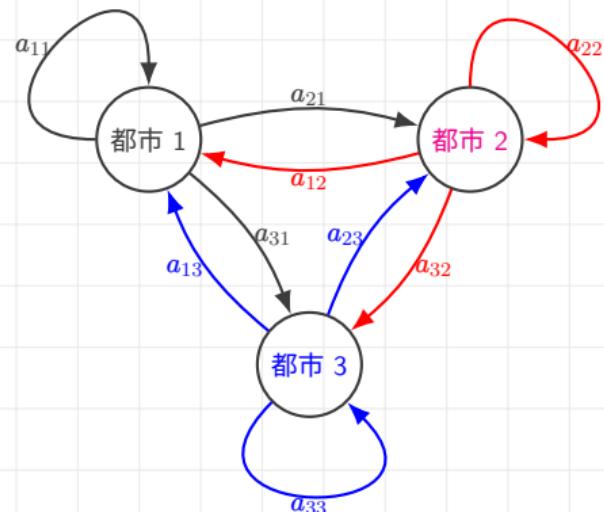
## 3 都市のケース

都市 1 からの移動:  $a_{11} + a_{21} + a_{31} = 1$ ,

都市 2 からの移動:  $a_{12} + a_{22} + a_{32} = 1$ ,

都市 3 からの移動:  $a_{13} + a_{23} + a_{33} = 1$ ,

割合は 0 以上:  $a_{ij} \geq 0$  ( $i, j = 1, 2, 3$ ).



- 都市  $j$  の現在の人口を  $x_j^0$ , 1 年後の人口を  $x_j^1$  とし,

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & \textcolor{red}{a_{12}} & \textcolor{blue}{a_{13}} & \cdots & a_{1n} \\ a_{21} & \textcolor{red}{a_{22}} & \textcolor{blue}{a_{23}} & \cdots & a_{2n} \\ a_{31} & \textcolor{red}{a_{32}} & \textcolor{blue}{a_{33}} & \cdots & a_{3n} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & \textcolor{red}{a_{n2}} & \textcolor{blue}{a_{n3}} & \cdots & a_{nn} \end{pmatrix}, \quad \boldsymbol{x}^0 = \begin{pmatrix} x_1^0 \\ x_2^0 \\ x_3^0 \\ \vdots \\ x_n^0 \end{pmatrix}, \quad \boldsymbol{x}^1 = \begin{pmatrix} x_1^1 \\ x_2^1 \\ x_3^1 \\ \vdots \\ x_n^1 \end{pmatrix}$$

とすると, 1 年後の人口は次のように表される:

$$\boldsymbol{x}^1 = A\boldsymbol{x}^0.$$

$$\rightsquigarrow \lim_{k \rightarrow \infty} \boldsymbol{x}^k \text{ はどのような値になるか?}$$

**補足** 行列  $A$  の各成分は非負では各列の和は 1.

この転置行列 (各成分が非負で各行の成分の和が 1 の行列) を**推移確率行列** と呼ぶ.

## $n$ 都市間での人口移動の場合

### 推移確率行列の固有値に関する性質

推移確率行列  $A$  のすべての成分が正とする。このとき次の性質が成り立つ:

- 推移確率行列  $A$  における**絶対値が最大の固有値は 1** である。
  - 固有値 1 に対応する固有ベクトルとして、**成分が全て正のベクトルが存在** する。
- 
- 上の定理の仮定を満たす推移確率行列  $A$  に対し、  
固有値 1 に対応する固有ベクトルで成分が全て正のベクトルを  $\mathbf{x}^*$  ( $\mathbf{x}^* > \mathbf{0}$ ) とする。
  - このとき、1 をすべての成分が 1 のベクトルとすると、

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \mathbf{x}^k = \lim_{k \rightarrow \infty} A^k \mathbf{x}^0 = \frac{\mathbf{1}^T \mathbf{x}^0}{\mathbf{1}^T \mathbf{x}^*} \mathbf{x}^*$$

が成り立ち、都市の人口の比率は  $\mathbf{x}^*$  の成分の比率に収束する。

(補足:  $\mathbf{x}^*$  の存在性はペロン・フロベニウスの定理で示せる)

# まとめ

## 講義の振り返り

- 行列指数関数
- 1 階の線形微分方程式系の求解
- 軍拡モデルと都市の人口移動モデル

## 自宅での復習

- 対角化可能な場合の行列指数関数の計算方法を確認する.
- 線形微分方程式系の求解の流れを確認する.
- 2 都市間の人口移動モデルの議論を確認する.