

任意温度下 Coulomb 气体内高斯震荡的中偏差

本科毕业论文答辩

答辩人：杨润哲

数学与统计学院

指导老师：高付清教授



- ① 研究背景
- ② 主要结果
- ③ 研究方法
- ④ 参考文献

- ① 研究背景
- ② 主要结果
- ③ 研究方法
- ④ 参考文献

什么是 Coulomb 气体？

在物理学中，Coulomb 气体，也称为“单分量等离子体”，是在静电力作用下相互作用的带电粒子的多体系统，它是统计力学中非常常见的在微观上不同但在宏观上相同的系统，在数学物理的文献中受到了广泛关注。

在本文中，我们将研究逆温度 β 下的 d 维 Coulomb 气体（其中 $d \geq 2$ ），它由 Gibbs 测度所刻画：

$$d\mathbb{P}_{N,\beta}(X_N) = \frac{1}{Z_{N,\beta}^V} \exp\left(-\beta N^{\frac{2}{d}-1} H_N(X_N)\right) dX_N$$

其中 $X_N = (x_1, \dots, x_N)$ 是每一个分量在 \mathbb{R}^d 中的 N 元组， $H_N(X_N) := \sum_{1 \leq i \neq j \leq N} g(x_i - x_j) + N \sum_{i=1}^N V(x_i)$ 是系统在状态 X_N 中的能量， g 是 green 函数。

为什么要引入新的运输方法？

其中的正规化常数称作配分函数，定义为

$$Z_{N,\beta}^V := \int_{(\mathbb{R}^d)^N} \exp\left(-\beta N^{\frac{2}{d}-1} \mathcal{H}_N(X_N)\right) dX_N$$

给定定义在 \mathbb{R}^d 上的函数 ξ ，通常我们使用基于 [Joh98] 中的 Johansson 方法对震荡函数 $\text{Fluct}(\xi)$ 进行控制，定义为

$$\text{Fluct}(\xi) := \sum_{i=1}^N \xi(x_i) - N \int \xi d\mu_\theta(x) \quad (1)$$

其中 $\theta = \beta N^{\frac{2}{d}}$

该方法的核心在于计算 $\mathbb{E}_{\mathbb{P}_{N,\beta}} \left(e^{-\beta t N^{\frac{2}{d}} \sum_{i=1}^N \xi(x_i)} \right)$ ，简化到计算配

分函数比值 $\frac{Z_{N,\beta}^{V_t}}{Z_{N,\beta}^V}$ (势场 $V_t := V + t\xi$)

为什么要引入运输方法？

而注意到

$$\frac{Z_{N,\beta}^{V_t}}{Z_{N,\beta}^V} = \exp\left(-\beta N^{1+\frac{2}{d}}(\mathcal{E}_\theta^{V_t}(\mu_\theta^t) - \mathcal{E}_\theta^V(\mu_\theta))\right) \frac{K_N(\mu_\theta^t)}{K_N(\mu_\theta)}$$

其中 μ_θ 与 μ_θ^t 分别是势场为 V 和 V_t 的 Coulomb 气体的热平衡测度，而

$$\mathcal{E}^V(\mu) := \int_{\mathbb{R}^d \times \mathbb{R}^d} \mathbf{g}(x-y) d\mu(x) d\mu(y) + \int_{\mathbb{R}^d} V(x) d\mu(x)$$

我们发现如果使用这种方法，估计 $\frac{K_N(\mu_\theta^t)}{K_N(\mu_\theta)}$ 这一项是复杂的。因此引入了新的运输方法，即在 2018 年 T. Leblé 和 S. Serfaty 于 [LS17] 中使用的方法——用形式为 $(\text{Id} + t\psi)\#\mu_\theta$ 的逼近 $\tilde{\mu}_\theta^t$ 来代替 μ_θ^t ($\#$ 表示与概率测度的复合)。

- ① 研究背景
- ② 主要结果
- ③ 研究方法
- ④ 参考文献

基本假设

定义算子: $L = \frac{1}{c_d \mu_\theta} \Delta$

下面我们假设: $\xi \in C^4$, $\text{supp } \xi \subset Q_\ell \subset \hat{\Sigma}$, $\hat{\Sigma}$ 是在 $\text{supp } \mu_\infty$ 中的某个子集, ℓ 满足: $|\xi|_{C^k} \leq C\ell^{-k}$, $\forall k \leq 4$ 的固定常数

记 V 是 \mathbb{R}^d 上的实值函数, 下面假设 $V \in C^7$, 满足:

当 $d \geq 3$ 时:

$$\int_{|x| \geq 1} \exp\left(-\frac{\theta}{2} V(x)\right) dx < \infty \quad (2)$$

$$V \rightarrow +\infty \text{ 当 } |x| \rightarrow \infty \quad (3)$$

当 $d = 2$ 时:

$$\int_{|x| \geq 1} e^{-\frac{\theta}{2}(V(x) - \log|x|)} dx + \int_{|x| \geq 1} e^{-\theta(V(x) - \log|x|)} |x| \log^2|x| dx < \infty \quad (4)$$

$$\liminf_{|x| \rightarrow \infty} (V + g) = +\infty \quad (5)$$

二维情况

定理

记 $\theta = \beta N$ ，设实数列 (τ_N) 满足：当 $N \rightarrow \infty$ 时， $\frac{\tau_N}{N^8} \rightarrow 0$ 和

$\tau_N \rightarrow \infty$ ，对任意固定的逆温度 β ，有：

$$\exp(-\tau^2 \ell^4 \beta v(\xi)) \mathbb{E}_{\mathbb{P}_{N,\beta}}(\exp(\tau \beta \ell^2 (\text{Fluct}(\xi) - m(\xi)))) \\ = \exp(O(\tau_N^4 N^{-4}))(N \rightarrow \infty)$$

在 $|\tau| \leq \tau_N$ 上一致成立，其中

$$v(\xi) = \frac{3}{2c_2} \int_{\mathbb{R}^2} |\nabla \xi|^2 + \frac{1}{2\theta} \int_{\mathbb{R}^2} \mu_\theta |L(\xi)|^2 \quad (6)$$

$$m(\xi) = \frac{1}{4} \int_{\mathbb{R}^2} \left(\frac{\Delta \xi}{c_2} \right) \log \mu_\theta \quad (7)$$

二维下的大偏差

因此，我们可以应用 [DZ09] 中的 Gärtner–Ellis 定理来获得高斯震荡的大偏差原理：

推论

$\frac{\ell^2 \beta}{\tau_N} \text{Fluct}(\xi)$ 按 τ_N^2 的速度满足大偏差原则，其速率函数为 $J(x) = \frac{x^2}{r(\xi)}$ ，其中

$$r(\xi) := \ell^4 \beta \frac{3}{2c_2} \int_{\mathbb{R}^2} |\nabla \xi|^2$$

RMK: 在 [LLW19] 中，作者使用更一般的 Fourier 级数方法给出了一维情况下 β -cluster 的线性统计量的正态渐近速度，但其方法的缺陷是无法导出像上面定理中的指数渐近估计。

二维下的正态渐近速度

推论

设 ϕ_N 是 $\text{Fluct}(\xi) - m(\xi) := \sum_{i=1}^N \xi(x_i) - N \int \xi d\mu_\theta(x)$ 的特征函数，而 ϕ 是正态分布 $N(0, \frac{3}{c_2\beta} \int_{\mathbb{R}^2} |\nabla \xi|^2)$ 的特征函数，则对 \mathbb{R} 中的任意一个紧致集 K ，我们有：

$$\sup_{x \in K} |\phi_N(x) - \phi(x)| = O\left(N^{-\frac{1}{8}} \log^{\frac{3}{4}} N\right)$$

RMK：当维数 $d > 2$ 时，此时若想要高斯震荡收敛到正态分布，需要另一种极限的趋向方式，见 [Ser23] 中推论 2.4。

高维情况: $d > 2$

定理

记 $\theta = \beta N^{\frac{2}{d}}$, 设数列 (τ_N) 满足: 当 $N \rightarrow \infty$ 时, $\frac{\tau_N}{N^{\frac{1}{2} + \frac{1}{d}}} \rightarrow 0$ 和 $\frac{\tau_N}{N^{\frac{1}{2} - \frac{1}{d^2} - \frac{1}{4d}}} \rightarrow \infty$, 则对任意固定的逆温度 β 有:

$$\exp(-\tau^2 \ell^4 \beta v(\xi)) \mathbb{E}_{\mathbb{P}_{N,\beta}} \left(\exp \left(\tau N^{\frac{1}{d} - \frac{1}{2}} \beta \ell^2 (\text{Fluct}(\xi) - N^{1 - \frac{2}{d}} m(\xi)) \right) \right) \\ = \exp \left(O \left(\tau_N N^{\frac{1}{2} - \frac{1}{d^2} - \frac{1}{4d}} \right) \right)$$

在 $|\tau| \leq \tau_N$ 上一致成立, 其中

$$v(\xi) = \frac{3}{2c_d} \int_{\mathbb{R}^d} |\nabla \xi|^2 + \frac{1}{2\theta} \int_{\mathbb{R}^d} \mu_\theta |L(\xi)|^2 \quad (8)$$

$$m(\xi) = \left(1 - \frac{2}{d} \right) \int_{\mathbb{R}^d} \left(\frac{\Delta \xi}{c_d} \right) \left(f_d(\beta \mu_\theta^{1 - \frac{2}{d}}) + \beta \mu_\theta^{1 - \frac{2}{d}} f'_d(\beta \mu_\theta^{1 - \frac{2}{d}}) \right) \quad (9)$$

高维情况下的大偏差

推论

$\frac{\ell^2 \beta}{\tau_N} (\text{Fluct}(\xi) - N^{1-\frac{2}{d}} m(\xi))$ 按 τ_N^2 的速度满足大偏差原则, 其速率函数为 $J(x) = \frac{x^2}{r(\xi)}$, 其中

$$m(\xi) = \left(1 - \frac{2}{d}\right) \int_{\mathbb{R}^d} \left(\frac{\Delta \xi}{c_d}\right) \left(f_d(\beta \mu_\theta^{1-\frac{2}{d}}) + \beta \mu_\theta^{1-\frac{2}{d}} f_d'(\beta \mu_\theta^{1-\frac{2}{d}})\right)$$

$$r(\xi) := \ell^4 \beta \frac{3}{2c_d} \int_{\mathbb{R}^d} |\nabla \xi|^2$$

其他文献中的结果

定理 (G. Lambert, M. Ledoux, C. Webb, 2019)

设 $V: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ 满足一定的正则性条件, 如果 $f \in C_c^{\kappa+4}(\mathbb{R})$, γ_1 满足一维正态分布, $(\lambda_1, \dots, \lambda_N)$ 满足一维 β -ensemble 的分布

$$\mathcal{X}_N(f) := \sqrt{\frac{\beta}{2\Sigma(f)}} \left(\sum_{j=1}^N f(\lambda_j) - N \int_J f(x) \mu_V(dx) - \left(\frac{1}{2} - \frac{1}{\beta} \right) \mathbf{m}(f) \right) \quad (10)$$

其中 $J = [-1, 1]$, 则我们有:

$$W_2(\mathcal{X}_N(f), \gamma_1) \ll_f N^{-\theta+\varepsilon}$$

其中是 W_2 是 Wasserstein-2 距离, $\theta = \min \left\{ \frac{2\kappa-9}{2\kappa+11}, \frac{2}{3} \right\}$ 。

其他文献中的结果

定理 (F. Gao, J. Mu, 2022)

记 $\mathbb{P}_{N,\beta}^{V;[b_-,b_+]}$ 是区间 $[b_-, b_+]$ 上一维 β -ensemble 的概率测度, 设正数列 (r_N) 满足: 当 $N \rightarrow \infty$ 时, $r_N \rightarrow \infty$ 和 $r_N/N \rightarrow 0$ 。若函数 V 满足一定的条件时, 则我们有:

$$\begin{aligned} & \exp\left\{-\frac{t^2}{2}v(g)\right\}\mathbb{E}_{N,\beta}^V\left(\exp\left\{t\left(M_N(g)-N\int g(\xi)\mu_V(d\xi)-m(g)\right)\right\}\right) \\ & =\exp\left\{O\left(\frac{r_N^3}{N}\right)\right\} \quad (11) \end{aligned}$$

在 $t \in [-r_N, r_N]$ 上一致的成立, 其中 $M_N(g) := \sum_{j=1}^N g(\lambda_j)$, 而 $\mathbb{E}_{N,\beta}^V$ 是 $\mathbb{P}_{N,\beta}^{V;[b_-,b_+]}$ 的期望。

- ① 研究背景
- ② 主要结果
- ③ 研究方法**
- ④ 参考文献

简要思路

1. 运输函数选择：根据定义， μ_θ^t 是势场 $V_t = V + t\xi$ 的热平衡测度，并且满足

$$g * \mu_\theta^t + V_t + \frac{1}{\theta} \log \mu_\theta^t = C_{\theta,t} \quad (12)$$

对关于 t 变量进行线性化（一阶展开），注意热平衡测度 μ_θ 也满足类似的等式，将两式相减，得知我们应该选择满足下列等式的函数 ψ ：

$$-g * (\operatorname{div}(\psi \mu_\theta)) + \xi - \frac{1}{\theta \mu_\theta} \operatorname{div}(\psi \mu_\theta) = 0 \quad (13)$$

我们可以解出：

$$\psi = -\frac{\nabla h}{c_d \mu_\theta}$$

其中 h 满足等式：

$$-\frac{\Delta h}{c_d \theta \mu_\theta} + h = \xi$$

简要思路

2. 运输测度选择：由于 ψ 无法在 $\text{supp } \xi$ 上局部化（见 [Ser23]），并且很难得到一个精细的有界性估计，我们通过同时选择两种运输测度来克服这个困难。

第一个是直接利用 ψ 运输 μ_θ ，即

$$\tilde{\mu}_\theta^t := (\text{Id} + t\psi)\#\mu_\theta \quad (14)$$

第二个是

$$\nu_\theta^t := \mu_\theta + \frac{t}{c_d} \Delta \xi \quad (15)$$

注意 ν_θ^t 是 $\tilde{\mu}_\theta^t$ 的一个很好的逼近（展开 $\tilde{\mu}_\theta^t$ ）。

简要思路

3. 误差估计：我们可以将高斯震荡的拉普拉斯变换拆成四个部分，注意到：

$$\mathbb{E}_{\mathbb{P}_{N,\beta}} \left(e^{-t\beta N^{\frac{2}{d}} \sum_{i=1}^N \xi(x_i)} \right) = e^{-\beta N^{1+N\frac{2}{d}} (\mathcal{E}_\theta^{V_t}(\nu_\theta^t) - \mathcal{E}_\theta^V(\mu_\theta))} \frac{K_N(\nu_\theta^t) K_N(\tilde{\mu}_\theta^t)}{K_N(\tilde{\mu}_\theta^t) K_N(\mu_\theta)}$$

$$\mathbb{E}_{Q_N(\nu_\theta^t)} \left(\exp \left(-\theta \int_{\mathbb{R}^d} \varepsilon_t d \left(\sum_{i=1}^N \delta_{x_i} - N\nu_\theta^t \right) \right) \right) \quad (16)$$

其中 $K_N(\mu)$ 是配分函数 ($Q_N(\mu)$ 是他的伴随测度)，定义为：

$$K_N(\mu) = \int_{(\mathbb{R}^d)^N} \exp \left(-\beta N^{\frac{2}{d}-1} F_N(X_N, \mu) \right) d\mu^{\otimes n}(X_N) \quad (17)$$

而

$$\varepsilon_t := g * \nu_\theta^t + V + t\xi + \frac{1}{\theta} \log \nu_\theta^t - C_\theta \quad (18)$$

简要思路

我们可以用上式将被运输后的项和原项逼近后的误差分为四个部分：

$$\left| \log \mathbb{E}_{\mathbb{P}_{N,\beta}} \left(\exp \left(-t\beta N^{\frac{2}{d}} \text{Fluct}(\xi) \right) \right) - t^2 N^{1+\frac{2}{d}} \beta v(\xi) + tN\beta m(\xi) \right|$$

$$\leq \sum_{i=1}^4 |\text{Error}_i|$$

其中

$$v(\xi) = \frac{3}{2c_d} \int_{\mathbb{R}^d} |\nabla \xi|^2 + \frac{1}{2\theta} \int_{\mathbb{R}^d} \mu_\theta |L(\xi)|^2$$

$$m(\xi) = \begin{cases} \frac{1}{4} \int_{\mathbb{R}^2} \left(\frac{\Delta \xi}{c_2} \right) \log \mu_\theta & \text{当 } d=2 \\ \left(1 - \frac{2}{d}\right) \int_{\mathbb{R}^d} \left(\frac{\Delta \xi}{c_d} \right) \left(f_d(\beta \mu_\theta^{1-\frac{2}{d}}) + \beta \mu_\theta^{1-\frac{2}{d}} f'_d(\beta \mu_\theta^{1-\frac{2}{d}}) \right) & \text{当 } d \geq 3 \end{cases}$$

而四个部分的误差：

$$|\text{Error}_1| = \beta N^{1+\frac{2}{d}} |\mathcal{E}_\theta^{V_t}(\nu_\theta^t) - \mathcal{E}_\theta^V(\mu_\theta) - t \int_{\mathbb{R}^d} \xi d\mu_\theta - t^2 v(\xi)|$$

$$|\text{Error}_2| = \left| \log \mathbb{E}_{\mathbf{Q}_N(\nu_\theta^t)} \left(\exp \left(-\theta \int_{\mathbb{R}^d} \varepsilon_t d \left(\sum_{i=1}^N \delta_{x_i} - N\nu_\theta^t \right) \right) \right) \right|$$

$$|\text{Error}_3| = \left| \log \frac{K_N(\tilde{\mu}_\theta^t)}{K_N(\mu_\theta)} + tN\beta m(\xi) \right|$$

$$|\text{Error}_4| = \left| \log \frac{K_N(\nu_\theta^t)}{K_N(\tilde{\mu}_\theta^t)} \right|$$

下面我们可以用不同的引理来估计。

简要思路

引理 (第一项误差)

$$\mathcal{E}_\theta^{V_t}(\nu_\theta^t) - \mathcal{E}_\theta^V(\mu_\theta) - t \int_{\mathbb{R}^d} \xi d\mu_\theta = -t^2 v(\xi) + O\left(\frac{t^3}{\theta} \int_{\mathbb{R}^d} \mu_\theta |L(\xi)|^3\right)$$

证明.

直接计算 $\mathcal{E}_\theta^{V_t}(\nu_\theta^t) - \mathcal{E}_\theta^V(\mu_\theta)$, 利用 μ_θ 满足等式:

$$g * \mu_\theta + V + \frac{1}{\theta} \log \mu_\theta = C_\theta$$

然后对得到等式中的 \log 函数进行 Taylor 展开, 最后利用 ν_θ^t 的定义可以得到结果。 □

简要思路

接下来的引理来自 [Ser23] 中的引理 5.4。

引理 (第二项误差)

$$\left| \log \mathbb{E}_{\mathbb{Q}_N(\nu_\theta^t)} \left(\exp \left(-\theta \int_{\mathbb{R}^d} \varepsilon_t d \left(\sum_{i=1}^N \delta_{x_i} - N\nu_\theta^t \right) \right) \right) \right|$$
$$\leq C \sqrt{\chi(\beta)} \beta N^{1+\frac{1}{d}} \ell^d |\varepsilon_t|_{C^1} + C \theta N \ell^d |\varepsilon_t|_{C^1}^2$$

简要思路

引理 (第三项误差)

如果 $d = 2$, 我们有

$$\log \frac{K_N(\tilde{\mu}_\theta^t)}{K_N(\mu_\theta)} = tN \frac{\beta}{4} \int_{\mathbb{R}^d} \operatorname{div}(\psi \mu_\theta) \log \mu_\theta + O\left(t\beta\chi(\beta)N\ell^d \left(\max_{s \in [0, D_N(\psi)]} \mathcal{R}_s\right)\right)$$

如果 $d \geq 3$, 我们有

$$\log \frac{K_N(\tilde{\mu}_\theta^t)}{K_N(\mu_\theta)} = tN \left(1 - \frac{2}{d}\right) \int_{\mathbb{R}^d} \operatorname{div}(\psi \mu_\theta) \left(f_d(\beta \mu_\theta^{1-\frac{2}{d}}) + \beta \mu_\theta^{1-\frac{2}{d}} f'_d(\beta \mu_\theta^{1-\frac{2}{d}})\right) + O\left(t\beta N \ell^d \left(\max_{s \in [0, D_N(\psi)]} \mathcal{R}_s\right) D_N(\psi)^{-1}\right) + o(1)$$

简要思路

证明.

和 [Ser23] 中引理 7.2 思路一致。直接计算 $\log \frac{K_N(\tilde{\mu}_\theta^t)}{K_N(\mu_\theta)}$ 再进行展开，利用论文中的引理 2.3.4 与 2.3.5（局部法则）。 \square

引理（第四项误差）

如果 $V \in C^7$ ，则我们有

$$\begin{aligned} & |\log K_N(\nu_\theta^t) - \log K_N(\tilde{\mu}_\theta^t)| \\ & \leq C\beta\chi(\beta)N\ell^d t^2 ((|\xi|_{C^1} + |\xi|_{C^3}) + |\xi|_{C^1}|\xi|_{C^3} + \ell(|\xi|_{C^1}|\xi|_{C^2} + \\ & |\xi|_{C^1}|\xi|_{C^4} + |\xi|_{C^2}|\xi|_{C^2}) \end{aligned}$$

证明.

在 [Ser23] 中的式子 (7.6.2) 令 $q=0$ 即得。 \square



简要思路

4. t 的选择: 我们选择 $t = -\tau N^{-\frac{1}{2} - \frac{1}{d}} \ell^2$, 其中 $|\tau| \leq \tau_N$, τ_N 的阶数由不同的维数确定。这样取是为了保证在最后得到的高斯震荡的 Laplace 估计

$$\exp(-\tau^2 \ell^4 \beta v(\xi)) \mathbb{E}_{\mathbb{P}_{N,\beta}} \left(\exp \left(\tau N^{\frac{1}{d} - \frac{1}{2}} \beta \ell^2 \{ \text{Fluct}(\xi) - N^{1 - \frac{2}{d}} m(\xi) \} \right) \right)$$

中 $\text{Fluct}(\xi)$ 前面的系数不会包含 N 的负次幂因而趋向无穷小, 同时又使 t 满足引理所需的条件。

5. 大偏差推论: 运用 [DZ09] 中的定理 2.3.6 即可计算出速率函数。

- ① 研究背景
- ② 主要结果
- ③ 研究方法
- ④ 参考文献

- [AS19a] Scott Armstrong and Sylvia Serfaty.
Local laws and rigidity for coulomb gases at any temperature.
The Annals of Probability, (1), 2019.
- [AS19b] Scott Armstrong and Sylvia Serfaty.
Thermal approximation of the equilibrium measure and obstacle problem.
Annales de la Faculté des sciences de Toulouse : Mathématiques, (4), 2019.
- [CSA20] Gabriel Cardoso, Jean-Marie Stéphan, and Alexander G Abanov.
The boundary density profile of a coulomb droplet. freezing at the edge.
Journal of Physics A: Mathematical and Theoretical, 54(1):015002, dec 2020.
- [DZ09] Amir Dembo and Ofer Zeitouni.
Large Deviations Techniques and Applications.
Springer Berlin, Heidelberg, 2009.
- [GM22] Fuqing Gao and Jianyong Mu.
Moderate deviations for linear eigenvalue statistics of β -ensembles.
Random Matrices: Theory and Applications, 11(2):2250017, 2022.
- [Joh98] K. Johansson.
On fluctuations of eigenvalues of random hermitian matrices.
Duke Math. J., 91(1):151–204, 1998.
- [LLW19] Gaultier Lambert, Michel Ledoux, and Christian Webb.
Quantitative normal approximation of linear statistics of β -ensembles.
The Annals of Probability, 47(5):pp. 2619–2685, 2019.
- [LS17] Thomas Leblé and Sylvia Serfaty.
Large deviation principle for empirical fields of log and riesz gases.
Inventiones mathematicae, 210:645–757, 2017.

- [LS18] Thomas Leblé and Sylvia Serfaty.
Fluctuations of two dimensional coulomb gases.
Geometric and Functional Analysis, 28:443–508, 2018.
- [Ser15] Sylvia Serfaty.
Coulomb gases and ginzburg-landau vortices, 2015.
- [Ser23] Sylvia Serfaty.
Gaussian fluctuations and free energy expansion for coulomb gases at any temperature.
Annales de l'Institut Henri Poincaré, Probabilités et Statistiques, 59(2):1074 – 1142, 2023.

感谢您的观看!