

である。相関関数の $\tau=23\text{cm}$ の所での値のみ関与していることに注意すれば、他の Index との関係は明らかである。即ち、 $\rho(h)$ が同一の路面を考えた場合、標本分散とは線型関係、T.C.R.とは2次関数の関係がある等である。

以上までの考察により、 σ^2 が重要な因子であること、 $\rho(h)$ の局所的な性質のみが関与していることなどがわかる。 μ 、 σ^2 及び $\rho(h)$ しか関与しないことは $X(t)$ の正規定常性の仮定から当然なのであるが、以下で我々は μ 、 σ^2 及び $\rho(h)$ を各々単独で推定する方法、しかも測定の簡便さを失わない方法を考察する。

6 交点法

$0 \leq t \leq T$ における $X(t)$ とレベル C との交点数を $N(C)$ とすれば

$$E[N(C)] = \frac{T}{\pi} \cdot \frac{\sigma}{\rho} \exp\left[-\frac{1}{2}\left(\frac{C-\mu}{\sigma}\right)^2\right]$$

である。ここで、 C として $m_0 \pm a$ 、 $m_1 \pm a$ の4本のレベルを考え、この各レベルについて $E[N(C)]$ を作り、 $m_0 \approx m_1$ 、 $m_0 \approx \mu$ 、 $a \approx 0$ の条件の下で μ 及び σ^2 について解く。そして、各レベルでの交点数の期待値をそれぞれのレベルの標本交点数で置き換える(モーメント法)ことにより以下の μ 及び σ^2 の推定量を得る。

分散が既知のときの平均の推定量;

$$\tilde{\mu} = m_0 + \frac{\sigma^2}{2a} \ln \frac{N(m_0+a)}{N(m_0-a)}$$

分散が未知のときの平均の推定量;

$$\tilde{\mu} = \frac{m_1 \ln(N(m_0+a)/N(m_0-a)) - m_0 \ln(N(m_1+a)/N(m_1-a))}{\ln(N(m_0+a)N(m_1-a)/N(m_0-a)N(m_1+a))}$$

平均が既知のときの分散の推定量;

$$\tilde{\sigma}^2 = 2a(\mu - m_0) / \ln(N(m_0+a)/N(m_0-a))$$

平均値が未知のときの分散の推定量;

$$\tilde{\sigma}^2 = 2a(m_1 - m_0) / \ln(N(m_0+a)N(m_1-a)/N(m_0-a)N(m_1+a))$$

Pr. I. 及び $\pm 5\text{mm}$ 範囲内百分率を求める時には、 μ の値が事前情報として必要であった。しかし、実際問題としては μ が未知の場合が多い。 $\tilde{\mu}$ 、 $\tilde{\sigma}^2$ はこれへの対応である。測定波と水平レベルとの交点数を観測することは、交点が長さなどの次元を持っていないので極めて簡便である。さて、この方法で問題となるのは m_0 、

m_1 、 a の決め方である。 $\tilde{\mu}$ 及び $\tilde{\sigma}^2$ については、シミュレーションにより次のような結果が得られる。 $\tilde{\mu}$ については、 μ を対称にして上下に a から $2a$ の程度離して2本のレベルをとることが望ましい。 $\tilde{\sigma}^2$ については、1本は μ に等しくとり、他の1本はそれから a ないし $2a$ の程度離してとることが望ましい。望ましいという意味は、推定量の分散が小さくなるということである。ここで、レベルの決め方で求めようとするパラメータを用いた表現をしているが、シミュレーションによれば、 $\tilde{\mu}$ や $\tilde{\sigma}^2$ など事前情報を用いないもので推定した値を代入してレベルを決めても、それほど推定の分散の増大は生じないようである。次に $\rho(h)$ の推定量については、 $X(t)$ とそれを e 方向へ、変位方向へ e だけ平行移動したもの、即ち $X(t+h)+e$ との交点数を $M(h|e)$ とすれば

$$\tilde{Y}(h) = \sigma^2 - e^2 / 4 \ln(M(h|0)/M(h|e))$$

として得られる。 e としては、3の前後の値にすると良いようである。交点数だけから $\rho(h)$ を推定できて便利であるが、最大の難点は $X(t)$ を復写したものが必要である点である。以上のような交点法の考え方は homogeneous normal random field $Z = Z(x, y)$ の分散を推定することにも利用できる。即ち、観測領域 D において、 $\mu(a)$ を単位面積中における $Z = Z(x, y)$ がレベル $Z = a$ と面断してできる境界の周りの長さの総和の平均とすれば(但し、 $E(x, y) = 0$ とする)

$$\sigma^2 = (a_1^2 - a_2^2) / 2 \ln \frac{\mu(a_2)}{\mu(a_1)}$$

である。さて、棒の長さを L 、 $\bar{n}(a)$ を $Z = a$ の上に実現した線分と棒との交点数の平均とすれば、 $Z(x, y)$ の分散の推定量として

$$\sigma^2 = (a_1^2 - a_2^2) / 2 \ln(\bar{n}(a_2)/\bar{n}(a_1))$$

が得られる。棒として円を用い、棒の方向の確率化を除去しておけば、更に簡単に計算できる。

[参考文献]

K. Inase; Estimation for a stationary Gaussian process by the numbers of crossings of levels, Rep. Stat. Appl. Res. JUSE, Vol. 22, P. 120-132