



现代物理学丛书

郭柏林 等编著  
于海

# 统计物理学进展

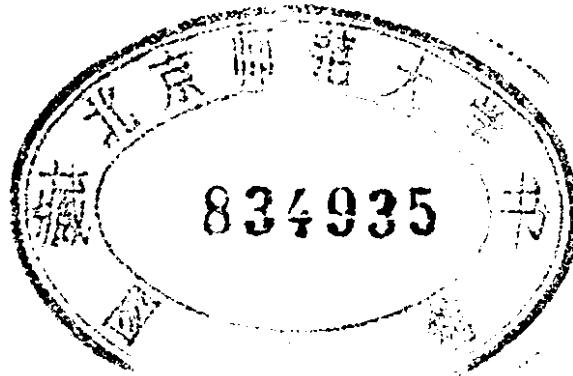
科学出版社

现代物理学丛书

# 统计物理学进展

郝柏林 于 浌 等编著

JJ111-4125



科学出版社

1981

## 内 容 简 介

统计物理学研究由大量客体组成的物理系统，它是固体、等离子体、液体、气体理论和激光理论的基础之一。本书采用格林函数、算子展开、投影算子以及随机微分方程等，论述相变和临界现象、非平衡问题（包括平衡附近的过程和远离平衡的现象，特别是耗散结构的形成）。全书共分八章：统计微扰论的生成泛函，连续相变与重正化群，低维合作现象，非平衡态统计理论概述，闭路格林函数和它在非平衡统计物理中的应用，开放系统的统计，耗散结构理论，随机微分方程。

本书可供理论物理工作者和高等院校有关专业师生参考。

现代物理学丛书

## 统计物理学进展

郝柏林 于 涌 等编著

责任编辑 陈菊华

科学出版社出版

北京朝阳门内大街 137 号

中国科学院印刷厂印刷

新华书店北京发行所发行 各地新华书店经售

\*

1981年11月第一版 开本：850×1168 1/32

1981年11月第一次印刷 印张：17

印数：0001—4,500 字数：446,000

统一书号：13031·1713

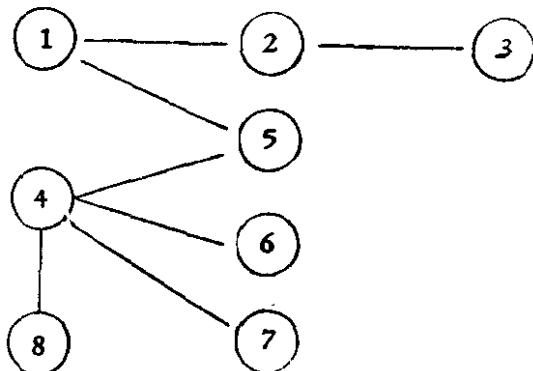
本社书号：2340·13—3

定 价： 3.15 元

## 序 言

统计物理学研究由大量客体组成的物理系统，它是固体、等离子体、液体、气体理论和激光理论的基础之一。它的概念和方法在原子核和基本粒子理论中也有许多应用，而且正日益广泛地渗透到化学、生物学等方面去。

统计物理学既是物理学理论，又有方法论问题。就物理对象而言，本书主要论述相变和临界现象、非平衡问题（包括平衡附近的过程和远离平衡的现象，特别是耗散结构的形成）。就方法论而言，主要阐述格林函数、算子展开、投影算子以及随机微分方程等。非平衡态统计约占本书篇幅的三分之二，这与当前统计物理学的发展趋势是一致的。本书各章在逻辑上大致有以下联系：



但每章内容相对完整，可以独立阅读，不受上述顺序限制。非平衡态统计是当前发展的前沿，有许多观点和方法还没有成为定论，请读者注意有关的新发展。还应指出，统计物理学的一些重要方面，如物理系统在不稳定点附近的行为、统计模型理论以及统计物理的若干严格结果等等，在本书中没有得到应有的反映。

本书各章内容都曾在 1978 年 8 月于庐山召开的中国物理学会年会期间，在统计物理学讨论会上报告过。这些报告评述了国际上的新进展，也反映了我国理论物理工作者的一些研究成果。会

后各作者又作了修改和补充，尽量给出了详细推导，以利阅读。书中各章的风格体例可能不大一致，在编辑成书时也未加以统一。各章都分别署上了作者姓名，以示负责。

我们希望本书的出版，对理论物理工作者和高等院校教师有所裨益。

# 目 录

<b>第一章 统计微扰论的生成泛函</b> .....	<b>郝柏林</b>	<b>1</b>
§ 1.1 数学准备.....		2
1.1.1 数、函数和泛函.....		2
1.1.2 变分导数.....		4
1.1.3 若干算子公式.....		8
1.1.4 连续积分.....		14
1.1.5 图论中的两个定理.....		17
§ 1.2 微扰论级数的生成泛函.....		20
1.2.1 统计模型与场论的对应关系.....		20
1.2.2 统计配分函数 $Z[J]$ ——不相连关联函数的生成泛函.....		23
1.2.3 自由能 $W[J]$ ——相连关联函数的生成泛函.....		28
1.2.4 热力学势 $\Gamma[M]$ ——顶角函数的生成泛函.....		32
1.2.5 圈图展开.....		37
§ 1.3 微扰论级数的发散问题.....		43
1.3.1 量纲分析——理论的分类.....		45
1.3.2 数幕定理——图的分类.....		50
1.3.3 微扰论低阶图的重正化.....		56
1.3.4 Zimmermann 的森林公式 .....		65
1.3.5 Callan-Symanzik 方程.....		68
参考文献.....		73
<b>第二章 连续相变和重正化群</b> .....	<b>于渌</b>	<b>76</b>
§ 2.1 平均场理论及其局限.....		77
2.1.1 Landau 理论 .....		77
2.1.2 其他相变的类比.....		82
2.1.3 涨落和空间维数.....		82
§ 2.2 标度变换与重正化群基本思想.....		83
2.2.1 讨论相变的不同模型.....		83
2.2.2 标度律.....		85
2.2.3 重正化群变换.....		87

2.2.4 高斯模型.....	89
2.2.5 $4-d$ 展开的递推公式.....	90
<b>§ 2.3 重正化群的基本性质.....</b>	<b>95</b>
2.3.1 模型与符号.....	95
2.3.2 重正化群的定义.....	97
2.3.3 生成元、不动点和线性化.....	99
2.3.4 渐近行为与临界指数.....	103
<b>§ 2.4 <math>1/n</math> 展开.....</b>	<b>106</b>
2.4.1 模型与符号.....	106
2.4.2 Dyson 方程.....	107
2.4.3 $R_s$ 变换 .....	109
2.4.4 生成元与不动点.....	110
2.4.5 线性化算子生成元和本征值.....	112
<b>§ 2.5 圈图展开与红外发散.....</b>	<b>114</b>
2.5.1 配分函数的连续积分表示.....	114
2.5.2 树图近似——平均场理论.....	115
2.5.3 单圈图近似.....	117
2.5.4 红外发散.....	119
<b>§ 2.6 重正化群的场论表述.....</b>	<b>121</b>
2.6.1 基本思想.....	121
2.6.2 临界点的重正化群方程.....	123
2.6.3 临界点以上的标度律.....	130
2.6.4 状态方程.....	133
<b>§ 2.7 微扰论与骨架图展开.....</b>	<b>136</b>
2.7.1 微扰论计算.....	137
2.7.2 骨架图展开.....	138
2.7.3 另一种微扰论计算.....	143
<b>§ 2.8 结束语.....</b>	<b>144</b>
<b>参考文献.....</b>	<b>146</b>
<b>第三章 低维合作现象.....</b>	<b>孙鑫 148</b>
<b>§ 3.1 Kohn 反常和 Peierls 相变 .....</b>	<b>148</b>
3.1.1 Kohn 反常.....	148
3.1.2 Peierls 相变 .....	151
<b>§ 3.2 超晶格和电荷密度波.....</b>	<b>153</b>
3.2.1 一维电荷密度波.....	153
3.2.2 二维电荷密度波.....	154

3.2.3 电荷密度波的元激发.....	154
<b>§ 3.3 非线性元激发.....</b>	<b>156</b>
3.3.1 瞬壁.....	156
3.3.2 峰状孤子.....	158
<b>§ 3.4 表面次能带和二维电子气.....</b>	<b>159</b>
3.4.1 液氦表面的电子层.....	159
3.4.2 二维等离子振荡.....	161
3.4.3 Wigner 晶格 .....	162
3.4.4 半导体反型层.....	162
参考文献.....	163
<b>第四章 非平衡态统计理论概述.....</b>	<b>霍裕平 165</b>
<b>§ 4.1 引言，非平衡态统计物理.....</b>	<b>165</b>
4.1.1 宏观与微观运动.....	165
4.1.2 宏观体系的基本属性.....	166
4.1.3 非平衡态统计理论发展概况及基本特点.....	170
<b>§ 4.2 玻耳兹曼方程，马尔科夫过程.....</b>	<b>173</b>
4.2.1 玻耳兹曼方程及其基本性质.....	
4.2.2 玻耳兹曼方程的谱，流体模.....	
4.2.3 Chapman-Enskog 展开及 Grad 解 .....	
4.2.4 玻耳兹曼方程的推导.....	
4.2.5 Master 方程，马尔科夫过程的讨论 .....	
<b>§ 4.3 非平衡态统计理论的基本方法.....</b>	<b>204</b>
4.3.1 密度矩阵.....	202
4.3.2 算子代数的基本概念.....	208
4.3.3 投影算子.....	213
<b>§ 4.4 趋向平衡.....</b>	<b>217</b>
4.4.1 有关趋向平衡的一些看法.....	217
4.4.2 动力系统理论.....	227
4.4.3 Master 方程和耗散条件 .....	230
4.4.4 描述宏观运动的子动力体系.....	242
<b>§ 4.5 线性输运过程.....</b>	<b>246</b>
4.5.1 非平衡态热力学概要.....	246
4.5.2 线性输运系数.....	250
4.5.3 输运系数的计算.....	258
4.5.4 波对输运过程的影响.....	261
参考文献.....	266

<b>第五章 闭路格林函数和它在非平衡统计物理中的应用.....</b>	
.....周光召、苏肇冰	268
<b>  § 5.1 闭路格林函数和微扰论.....</b>	269
5.1.1 密度矩阵和物理量的平均值.....	270
5.1.2 闭路格林函数.....	272
5.1.3 自由标量场的闭路格林函数.....	274
5.1.4 Wick 乘积和 Wick 定理 .....	281
5.1.5 微扰论.....	284
5.1.6 闭路连接格林函数和闭路顶点函数.....	286
5.1.7 紫外发散的消除和重正化.....	291
5.1.8 格林函数的 Lehmann 表示.....	298
<b>  § 5.2 近似均匀系统中的格林函数.....</b>	303
5.2.1 均匀系统格林函数的 Dyson 方程.....	303
5.2.2 热平衡态及其附近的格林函数.....	308
5.2.3 几个有用的运算规则.....	314
5.2.4 多时标微扰理论.....	322
5.2.5 二能级系统和激光状态.....	324
5.2.6 准粒子的输运方程.....	332
复合算子和序参量的格林函数.....	339
5.3.1 线性响应理论.....	340
5.3.2 序参量和状态的稳定性.....	344
5.3.3 格林函数的 Ward-Takahashi 恒等式 .....	346
5.3.4 序参量的朗之万方程和它的量子化.....	352
5.3.5 带时间的 Ginzburg-Landau 方程 .....	361
5.3.6 规范场格林函数的 W-T 恒等式.....	367
<b>参考文献.....</b>	371
<b>第六章 开放系统的统计.....</b>	李铁城 373
<b>  § 6.1 引论.....</b>	373
<b>  § 6.2 投影算符技术与广义朗之万方程.....</b>	377
<b>  § 6.3 研究开系的广义 Master 方程法.....</b>	386
<b>  § 6.4 开系的例子.....</b>	391
6.4.1 自扩散系数.....	391
6.4.2 激光.....	392
<b>参考文献.....</b>	397
<b>第七章 耗散结构理论.....</b>	方福康、刘若庄 398
<b>  § 7.1 引言.....</b>	398

§ 7.2 耗散结构的热力学基础	401
§ 7.3 反应扩散方程, 稳定性	419
§ 7.4 分支点分析	428
§ 7.5 随机理论与涨落	441
§ 7.6 非线性主导方程	449
§ 7.7 化学反应中的自组织作用(时间耗散结构示例)	459
7.7.1 引言	459
7.7.2 化学反应机理	460
7.7.3 反应动力学方程组	462
7.7.4 解的振荡行为	463
§ 7.8 进化问题	465
7.8.1 一般讨论	465
7.8.2 反应模型	466
7.8.3 动力学研究	467
7.8.4 热力学解释	468
参考文献	469
<b>第八章 随机微分方程</b>	<b>173</b>
§ 8.1 概论	173
8.1.1 因素、条件、概率	471
8.1.2 动态系统、随机过程与随机微分方程	474
§ 8.2 概率论与随机过程的若干预备知识	478
8.2.1 概率场	478
8.2.2 随机变量	479
8.2.3 矩	481
8.2.4 联合分布与边缘分布、相关矩与相关系数	482
8.2.5 条件数学期望	483
8.2.6 特征函数	485
8.2.7 高斯随机变量	486
8.2.8 随机过程的一般概念	487
8.2.9 马尔科夫过程	489
8.2.10 扩散过程	491
8.2.11 Wiener 过程	492
8.2.12 平稳过程	494
8.2.13 高斯过程	496
8.2.14 白噪音过程	496
8.2.15 均方极限运算	499
8.2.16 概率守恒等式、Fokker-Planck 方程	504

§ 8.3 具有随机初始条件的微分方程	508
8.3.1 线性情形	509
8.3.2 非线性情形	510
8.3.3 解过程的统计性质	510
8.3.4 刘维方程	512
§ 8.4 具有随机非齐次项的微分方程, 伊藤积分	513
8.4.1 $y(t)$ 是普通随机过程的情形	513
8.4.2 伊藤积分	514
8.4.3 伊藤方程及其解	519
8.4.4 Ornstein-Uhlenbeck 过程	524
8.4.5 过程的趋向平稳	526
§ 8.5 具有随机系数的微分方程	527
8.5.1 一般线性方程	527
8.5.2 李亚普诺夫稳定性	529
参考文献	531

# 第一章 统计微扰论的生成泛函

郝 柏 林

(中国科学院理论物理研究所)

本章主要是为后面涉及重正化群和闭路格林函数的各章作一些准备，介绍若干量子场论知识，例如微扰论级数的生成泛函、连续积分表示、圈图展开、Callan-Symanzik 方程，复合算子的重正化等等。这些内容在基本粒子和场论工作者中均已为人所共知，而一部分统计物理和固体理论工作者则尚不甚熟悉，但在今后工作中可能经常遇到。

统计和场论的相通之处在于无穷多自由度。无穷多自由度带来的问题在统计中表现得更为单纯。统计虽然免去了量子化、相对论协变性、旋量和狄拉克矩阵等等场论中必须考虑的原则和细节，但许多困难（例如微扰论级数的发散）仍然存在。想方设法把无穷多自由度约化为少量自由度来描述，在突变点附近甚至归结为一、两个自由度，这本来是热力学和统计物理学的基本精神。但是宏观系统中无穷多自由度的涨落背景是无法完全消除的，它们有时还起着决定作用。这是统计问题不同于力学或动力系统的根本之点，这就使统计更接近于量子场论。在一定意义上说，统计物理学是一种涨落场论，在处理非平衡问题时更是这样。当然，量子性在不少统计问题中也直接表现出来。因此，场论方法在统计物理学中的广泛应用，决不仅只是基于两者数学形式的类似，还有一些更为深刻的物理原因。

还应说明一点，本章的叙述比较形式，有许多技术性的推导，并集中介绍了一些必要的基本概念和辅助知识，内容比书中以后各章所引用的要稍多。

## §1.1 数学准备

描述无穷多自由度要使用泛函、变分导数、连续积分等概念。但作为入门，并不需要从现代数学的抽象形式开始。我们在这里采取了一种便于推导许多工作公式的实用观点，把泛函关系看作多元函数的极限情况。在叙述中不追求数学的严格性，但指出若干可供进一步查询的文献。

### 1.1.1 数、函数和泛函

对易经典数就是普通数域上的元素。实数域  $\mathbf{R}$  和复数域  $\mathbf{C}$  是大家熟知的，它们是无穷维的代数。有限维的域也是常见的，电子计算机中保存的数就是一例。反对易经典数是 Grassman 代数的元素，由于本书中用不到，以后不再详述（可参看[1]和[2]）。

对易和反对易本身都是经典性质。“量子”性表现在对易或反对易时出现的非零补充项上。如果某个有限维或无穷维代数的任何两个元素  $a$  和  $b$  满足

$$ab - \eta ba = 0,$$

则它们是经典的对易 ( $\eta = +1$ ) 或反对易 ( $\eta = -1$ ) 数。反之，如果对于某些  $a$  和  $b$ ，

$$ab - \eta ba \neq 0,$$

则它们是“量子”数。

在有限线段  $(0, L)$  上取离散点  $0, 1, \dots, n$ ，令第  $i$  点对应变量  $\varphi_i$ ，定义多元函数

$$F(\varphi_0, \varphi_1, \dots, \varphi_n),$$

取  $n \rightarrow \infty$  极限时，离散指标  $i$  成为连续变量  $x$ ，变量  $\varphi_i$  成为场  $\varphi(x)$ ，多元函数  $F$  成为函数  $\varphi(x)$  的泛函

$$F(\varphi_0, \varphi_1, \dots, \varphi_n) \xrightarrow{n \rightarrow \infty} F[\varphi(x)], \quad (0 \leq x \leq L)$$

当然，对于不同区间如  $(-\infty, \infty)$ ,  $(0, \infty)$  上的  $\varphi(x)$ ，都可以这

样引入泛函。

### 多元解析函数的马克劳林级数

$$F(\varphi_0, \varphi_1, \dots, \varphi_n) = \sum_{m=0}^{\infty} \frac{1}{m!} \sum_i \dots \\ \times \sum_{i_m} \left( \frac{\partial^m F}{\partial \varphi_{i_1} \dots \partial \varphi_{i_m}} \right)_0 \varphi_{i_1} \dots \varphi_{i_m},$$

取  $n \rightarrow \infty$  极限，成为解析泛函：

$$F[\varphi] = \sum_{m=0}^{\infty} \frac{1}{m!} \int \dots \int dx_1 \dots dx_m F^{(m)}(x_1, \dots, x_m) \\ \times \varphi(x_1) \dots \varphi(x_m).$$

如果  $\varphi(x)$  是经典对易场，则系数  $F^{(m)}$  是普通的对称函数；如果  $\varphi(x)$  是无穷维 Grassman 代数的元素，则  $F^{(m)}$  是完全反对称的函数。 $F^{(m)}$  可以通过泛函  $F[\varphi]$  的变分导数来表示，这将在后面介绍。

上面取极限过程中作了下列几种“代换”，这是有普遍意义的。

- (1) 离散指标  $i$  成为连续变量  $x$ ；
- (2) 变量  $\varphi_i$  成为场  $\varphi(x)$ ；
- (3) 常数成为函数；
- (4) 函数成为泛函；
- (5) 对离散指标的求和，换成对连续变量的求积。这里回避了测度问题，在最常见的情形下应有

$$\frac{1}{V} \sum_i \rightarrow \frac{1}{(2\pi)^d} \int d^d x,$$

其中  $V$  是体积， $d$  是空间维数。

由于我们经常要和泛函打交道，为了避免书写大量高维积分，必须简化记法。

首先，省去积分符号，对两次重复出现的自变量自动求积分。这是矩阵运算中省去求和符号，并对两次重复出现的角标自动求和（“爱因斯坦规则”）这一规定的推广。有时还把自变量简化为数

字。

其次，只要不引起误解，自变量也省去不写。这是广义的矩阵记法。

最后，在对易场（玻色子）情形下，有时把算子（矩阵）的书写顺序也打乱归并。

例 1

$$\int J(x)\varphi(x)dx = J(1)\varphi(1) = J\varphi.$$

例 2

$$\begin{aligned} \frac{1}{2} \int dx_1 dx_2 \varphi(x_1) K(x_1, x_2) \varphi(x_2) \\ = \frac{1}{2} \varphi(1) K(1, 2) \varphi(2) = \frac{1}{2} K\varphi^2. \end{aligned}$$

例 3 前面解析泛函的展开式可简化为

$$\begin{aligned} F[\varphi] &= \sum_{m=0}^{\infty} \frac{1}{m!} F^{(m)}(1, 2, \dots, m) \varphi(1) \varphi(2) \cdots \varphi(m) \\ &= \sum_{m=0}^{\infty} \frac{1}{m!} F^{(m)} \varphi^m. \end{aligned}$$

这种记法形式上与普通函数相同。以后将看到，这样作好处很多：便于微分，不必区分坐标表示与动量表示，自动给出对称项数目等。但必须注意，在必要时应写明自变量名字和保持正确顺序。

关于本小节的内容还可以参看[2—5]。

### 1.1.2 变分导数

我们只讨论对易场情况。对泛函的变分导数可以作为多元函数偏导数的极限引入。多元函数自变量作无限小改变时，函数增量的线性部分为

$$\begin{aligned} dF &= F(\varphi_1 + d\varphi_1, \dots, \varphi_n + d\varphi_n) \\ &\quad - F(\varphi_1, \dots, \varphi_n) = \sum_i A_i d\varphi_i, \end{aligned}$$

## 定义偏导数

$$A_i = \frac{\partial F}{\partial \varphi_i}.$$

同样, 泛函增量的线性部分为

$$\delta F[\varphi] = F[\varphi + \delta\varphi] - F[\varphi] = \int A[\varphi, x] \delta\varphi(x) dx,$$

## 定义变分导数

$$A[\varphi, x] = \frac{\delta F[\varphi]}{\delta\varphi(x)},$$

它是  $\varphi$  的泛函, 又可能是  $x$  的函数. 如同偏导数记号  $\frac{\partial F}{\partial \varphi_i}$  的分子、分母不能分开一样, 变分导数  $\frac{\delta F[\varphi]}{\delta\varphi(x)}$  也是不能拆开的记号.

实际计算变分导数时, 可以利用如下的定义:

$$\begin{aligned} \frac{\delta F[\varphi]}{\delta\varphi(x)} &= \lim_{\varepsilon \rightarrow 0} \frac{1}{\varepsilon} (F[\varphi(u) + \varepsilon\delta(x-u)] \\ &\quad - F[\varphi(u)]). \end{aligned}$$

变分导数具有与普通导数相似的性质:

(1) 与  $\varphi(x)$  无关的任意函数  $f(x), g(x)$  起普通导数中常数的作用, 例如

$$\frac{\delta f(x)}{\delta\varphi(y)} = 0,$$

$$\begin{aligned} \frac{\delta}{\delta\varphi(x)} \{fF[\varphi] + gG[\varphi]\} &= f \frac{\delta F[\varphi]}{\delta\varphi(x)} + g \frac{\delta G[\varphi]}{\delta\varphi(x)}, \\ \frac{\delta\varphi(x)}{\delta\varphi(y)} &= \delta(x-y) \quad (\text{有时简记为 } \frac{\delta\varphi}{\delta\varphi} = 1). \end{aligned}$$

(2) 泛函乘积的变分导数

$$\frac{\delta}{\delta\varphi} \{F[\varphi]G[\varphi]\} = \frac{\delta F[\varphi]}{\delta\varphi} G[\varphi] + F[\varphi] \frac{\delta G[\varphi]}{\delta\varphi}.$$

(3) 复合泛函的变分导数

$$\frac{\delta}{\delta\varphi(x)} F[G[\varphi]] = \int \frac{\delta F[G]}{\delta G[\varphi(y)]} \frac{\delta G[\varphi(y)]}{\delta\varphi(x)} dy,$$

或者按上一小节中的约定,简记为

$$\frac{\delta F[G[\varphi]]}{\delta \varphi} = \frac{\delta F}{\delta G} \frac{\delta G}{\delta \varphi}.$$

#### (4) 多元泛函的偏变分导数

多元泛函  $F[\varphi, \psi]$  的增量

$$\delta F = \int \left\{ \frac{\delta F}{\delta \varphi(x)} \delta \varphi(x) + \frac{\delta F}{\delta \psi(x)} \delta \psi(x) \right\} dx$$

中出现偏变分导数  $\frac{\delta F}{\delta \varphi}$  和  $\frac{\delta F}{\delta \psi}$ .

下面举几个变分导数的实例。

##### 例 1 指数泛函

$$Z[J] = \exp \left( \int dx J(x) \varphi(x) \right) = e^{J\varphi}$$

的变分导数可简记为

$$\frac{\delta Z}{\delta J} = \varphi e^{J\varphi},$$

形式上与普通导数相同,写全了就是

$$\frac{\delta Z[J]}{\delta J(x)} = \varphi(x) \exp \left( \int dx J(x) \varphi(x) \right).$$

再提醒一下,我们这里讨论的是对易场  $\varphi(x)$ .

##### 例 2 泛函平移算子

普通一元函数的平移算子

$$f(x + T) = \sum_{n=0}^{\infty} \frac{T^n}{n!} \frac{d^n f}{dx^n} = e^{T \frac{d}{dx}} f(x),$$

推广到多元函数是

$$F(\varphi_1 + T_1, \dots, \varphi_n + T_n) = e^{\sum_i T_i \frac{\delta}{\delta \varphi_i}} F(\varphi_1, \dots, \varphi_n),$$

取  $n \rightarrow \infty$  极限成为

$$F[\varphi + T] = e^{T \frac{\delta}{\delta \varphi}} F[\varphi],$$

其中