Probability Meets Linear Algebra

25 鸡兔同笼 3

鸡兔互变之马尔科夫奇妙夜



我们必须知道,我们终将知道。

Wir müssen wissen. Wir werden wissen.

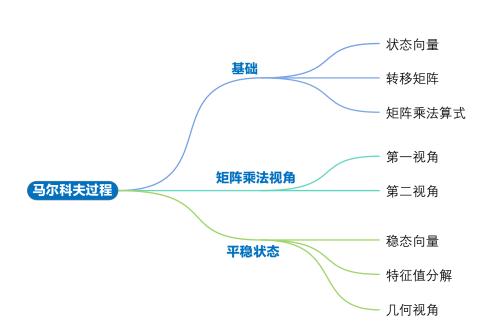
We must know. We shall know.

— 大卫·希尔伯特 (David Hilbert) | 德国数学家 | 1862 ~ 1943



- numpy.diag() 以一维数组的形式返回方阵的对角线元素,或将一维数组转换成对角阵
- numpy.linalg.eig() 特征值分解
- numpy.linalg.inv() 矩阵求逆
- numpy.matrix() 构造二维矩阵
- numpy.meshgrid() 产生网格化数据
- numpy.vstack() 垂直堆叠数组
- seaborn.heatmap() 绘制热图





25.1 鸡兔互变奇妙夜

怪哉,怪哉!

接连数月,村民发现一件奇事——夜深人静时,同笼鸡兔竟然互变!一些小兔变成小鸡,而一些小鸡变成小兔。

村民奔走相告,大家都惊呼,"我们都疯了!"

而一众村民中,农夫则显得处变不惊。在农夫眼里,村里发生的鸡兔互变像极了老子说的"祸兮,福之所倚;福兮,祸之所伏。"

农夫对村民说,"大家不要怕,恐惧都是来自于未知。我们必须知道,我们终将知道!福祸相生,是福不是祸,是祸躲不过。"

面对这个鸡兔互变的怪相,农夫决定用线性代数这个利器探究一番。

鸡兔互变过程图

农夫先是连续几日统计村里的鸡兔数量,他有个意想不到的发现——每晚有 30%的小鸡变成小兔,其他小鸡不变;与此同时,每晚有 20%小兔变成小鸡,其余小兔不变。变化前后鸡兔总数不变。

他先画了图 1 这幅图,用来描述鸡兔互变的比例。这个比例也就是概率值,即发生变化的可能性。

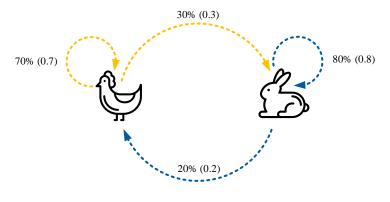


图 1. 鸡兔互变的比例

矩阵乘法

农夫想试试用矩阵乘法来描述这一过程。

第 k 天, 鸡兔的比例用列向量 $\pi(k)$ 表示, 比如:

$$\pi(k) = \begin{bmatrix} 0.3\\0.7 \end{bmatrix} \tag{1}$$

其中, $\pi(k)$ 第一行元素代表小鸡的比例 (0.3, 30%), π 第二行元素代表小兔的比例 (0.7, 70%).

第 k+1 天,鸡兔的比例用列向量 π(k+1) 表示。鸡兔互变的比例写成方阵 T,这样 $k \to k+1$ 变化过程可以写成:

$$k \to k+1$$
: $T\pi(k) = \pi(k+1)$ (2)

农夫翻阅线性代数典籍时发现 T 和 π 都有自己专门的名称: T 叫转移矩阵 (transition matrix); 列向量 π 叫做**状态向**量 (state vector)。

而整个鸡兔互变的过程也有自己的名称——马尔可夫过程 (Markov process)。

转移矩阵

鸡兔互变中, 转移矩阵 T 为:

$$T = \begin{bmatrix} 0.7 & 0.2 \\ 0.3 & 0.8 \end{bmatrix} \tag{3}$$

图 2 所示为转移矩阵 T 每个元素的具体含义。

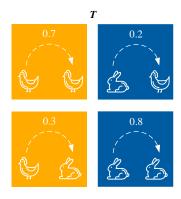


图 2. 转移矩阵 T

图 3 所示为用矩阵运算描述 $k \rightarrow k+1$ 鸡兔互变过程。

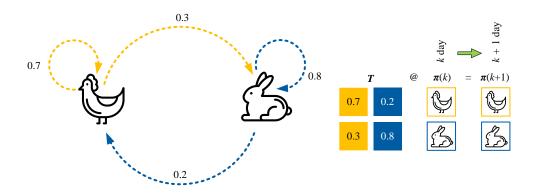


图 3. 用矩阵运算描述鸡兔互变

农夫注意到 T矩阵的每一列概率值相加为 1。也就是,这个 2×2 的方阵 T还可以写成:

$$T = \begin{bmatrix} p & q \\ 1 - p & 1 - q \end{bmatrix} \tag{4}$$

其中, p = 0.7, q = 0.2。

代入具体数值

农夫假设, 第 k 天鸡兔的比例为 60%和 40%, $\pi(k)$ 为:

$$\pi(k) = \begin{bmatrix} 0.6\\ 0.4 \end{bmatrix} \tag{5}$$

第 k+1 天,鸡兔比例为:

$$k \to k+1: \quad \boldsymbol{T\pi}(k) = \underbrace{\begin{bmatrix} 0.7 & 0.2 \\ 0.3 & 0.8 \end{bmatrix}}_{\boldsymbol{T}} \begin{bmatrix} 0.6 \\ 0.4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.5 \\ 0.5 \end{bmatrix} = \boldsymbol{\pi}(k+1)$$
 (6)

农夫想到这一计算可以用热图表达,于是他画了图 4。



图 4. 第 $k \to 3$ 第 k+1 天,状态转换运算热图

而第 k+2 天状态向量 $\pi(k+2)$ 和第 k+1 天状态向量 $\pi(k+1)$ 关系为:

本 PDF 文件为作者草稿,发布目的为方便读者在移动终端学习,终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。版权归清华大学出版社所有,请勿商用,引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载: https://github.com/Visualize-ML

本书配套微课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger: https://space.bilibili.com/513194466

欢迎大家批评指教,本书专属邮箱: jiang.visualize.ml@gmail.com

$$k+1 \rightarrow k+2$$
: $T\pi(k+1) = \pi(k+2)$ (7)

联立 (6) 和 (7), 得到第 k+2 天状态向量 $\pi(k+2)$ 和第 k 天状态向量 $\pi(k)$ 关系:

$$k \to k+2$$
: $T^2\pi(k) = \pi(k+2)$ (8)

图 5 所示为,第 k 天 \rightarrow 第 k+2 天,状态转换运算热图。

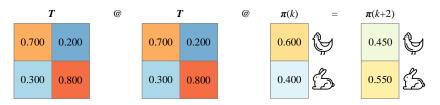


图 5. 第 $k \to 3$ 第 $k + 2 \to 4$ 状态转换运算热图

另一种形式

农夫在查找参考书时发现,也有很多典籍用行向量表达状态向量,即对等式(2)左右转置:

$$\boldsymbol{\pi}(k)^{\mathrm{T}}\boldsymbol{T}^{\mathrm{T}} = \boldsymbol{\pi}(k+1)^{\mathrm{T}} \tag{9}$$

这样, (6) 可以写成:

$$\pi (k+1)^{\mathrm{T}} = \begin{bmatrix} 0.6 & 0.4 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 0.7 & 0.3 \\ 0.2 & 0.8 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.5 & 0.5 \end{bmatrix}$$
 (10)

这种情况, 转移矩阵的每一行概率值相加为1。对应的矩阵运算热图为图6。

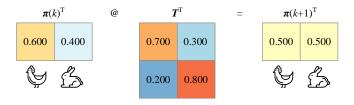


图 6. 第 $k \to 3$ 第 k + 1 天,状态转换运算热图,注意状态向量为行向量



Bk3 Ch25 1.py 计算状态向量转化, 并绘制图4和图5两幅热图。

本 PDF 文件为作者草稿,发布目的为方便读者在移动终端学习,终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。版权归清华大学出版社所有,请勿商用,引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载: https://github.com/Visualize-ML

本书配套微课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger: https://space.bilibili.com/513194466

欢迎大家批评指教,本书专属邮箱: jiang.visualize.ml@gmail.com

25.2 第一视角: "鸡/兔→鸡" 和 "鸡/兔→兔"

农夫想到自己学习矩阵乘法时,书上讲过矩阵乘法有两个主要视角。他想先用矩阵乘法第一视角来分析 (2) 矩阵运算式。

他把 T 写成两个行向量 $t^{(1)}$ 和 $t^{(2)}$ 上下叠加,代入 (2) 得到:

$$\begin{bmatrix} \boldsymbol{t}^{(1)} \\ \boldsymbol{t}^{(2)} \end{bmatrix} \boldsymbol{\pi}(k) = \begin{bmatrix} \boldsymbol{t}^{(1)} \boldsymbol{\pi}(k) \\ \boldsymbol{t}^{(2)} \boldsymbol{\pi}(k) \end{bmatrix} = \underbrace{\begin{bmatrix} \pi_1(k+1) \\ \pi_2(k+1) \end{bmatrix}}_{\boldsymbol{\pi}(k+1)}$$
(11)

鸡/兔→鸡

农夫发现只看(11)第一行运算的话,它代表的转化是"鸡/兔→鸡",如图7所示:

$$\begin{bmatrix} \boldsymbol{t}^{(1)} \\ \end{bmatrix} \boldsymbol{\pi}(k) = \begin{bmatrix} \boldsymbol{t}^{(1)} \boldsymbol{\pi}(k) \\ \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \pi_1(k+1) \\ \end{bmatrix}$$
 (12)

也就是说,上式代表第k天的鸡、兔,在第k+1天变为鸡。

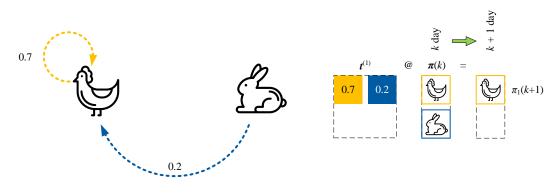


图 7. 鸡/兔→鸡

代入具体值,得到:

$$\begin{bmatrix} 0.7 & 0.2 \\ 0.4 \end{bmatrix} @ \begin{bmatrix} 0.6 \\ 0.4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.5 \\ 0.6 \end{bmatrix}$$

$$(13)$$

第 k 天的鸡兔的比例分别为 60%和 40%,到了 k+1 天,鸡的比例为 50%。图 8 所示为上述运算热图。

本 PDF 文件为作者草稿,发布目的为方便读者在移动终端学习,终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。版权归清华大学出版社所有,请勿商用,引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载: https://github.com/Visualize-ML

本书配套微课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger: https://space.bilibili.com/513194466

欢迎大家批评指教,本书专属邮箱: jiang.visualize.ml@gmail.com

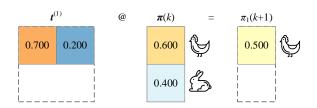


图 8. 第 $k \to 3$ 第 $k + 1 \to 4$ 2. 鸡/兔—鸡

鸡/兔→兔

图 9 所示为 (11) 第二行运算,它代表"鸡/兔 \rightarrow 兔"。也就是说,第 k 天的鸡、兔,第 k+1 天变为兔:

$$\begin{bmatrix} \mathbf{t}^{(2)} \end{bmatrix} \boldsymbol{\pi}(k) = \begin{bmatrix} \mathbf{t}^{(2)} \boldsymbol{\pi}(k) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \pi_2(k+1) \end{bmatrix}$$
(14)

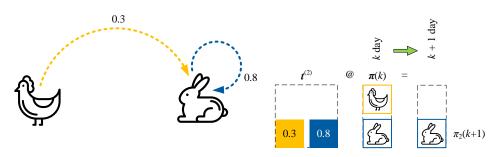


图 9. 鸡/兔 → 兔

图 10 所示为第 k 天的鸡兔的比例分别为 60%和 40%,到了 k+1 天,兔的比例也为 50%:

$$\begin{bmatrix} 0.3 & 0.8 \end{bmatrix} @ \begin{bmatrix} 0.6 \\ 0.4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.5 \end{bmatrix}$$

$$\pi(k) = \pi_2(k+1)$$

$$0.300 \quad 0.800$$

$$0.400 \quad 0.500$$

$$0.500 \quad 0.500$$

图 10. 第 $k \to 3$ 第 $k + 1 \to 4$ 鸡/兔 一鸡

这就是利用矩阵乘法第一视角来分析状态转化运算。

本 PDF 文件为作者草稿,发布目的为方便读者在移动终端学习,终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。版权归清华大学出版社所有,请勿商用,引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载: https://github.com/Visualize-ML

本书配套微课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger: https://space.bilibili.com/513194466

欢迎大家批评指教,本书专属邮箱: jiang.visualize.ml@gmail.com

25.3 第二视角: "鸡→鸡/兔"和 "兔→鸡/兔"

农夫继续用矩阵乘法第二视角分析(2)矩阵运算式。

他将转移矩阵 T 写成左右排列列向量 t_1 和 t_2 ,代入 (2) 展开得到:

$$\underbrace{\left[\boldsymbol{t}_{1} \quad \boldsymbol{t}_{2}\right]}_{\boldsymbol{T}} \underbrace{\left[\boldsymbol{\pi}_{1}(k)\right]}_{\boldsymbol{\pi}(k)} = \boldsymbol{\pi}_{1}(k)\boldsymbol{t}_{1} + \boldsymbol{\pi}_{2}(k)\boldsymbol{t}_{2} = \underbrace{\left[\boldsymbol{\pi}_{1}(k+1)\right]}_{\boldsymbol{\pi}(k+1)} \tag{16}$$

其中, π_1 代表鸡的比例, π_2 代表鸡的比例。

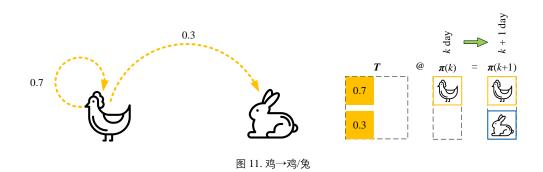
矩阵乘法第二视角将矩阵乘法 $T\pi(k) = \pi(k+1)$ 转化为矩阵加法 $\pi_1(k)t_1 + \pi_2(k)t_2$ 。农夫考虑分别 分析 $\pi_1(k)t_1$ 和 $\pi_2(k)t_2$ 代表的具体含义。

(16) 这个式子让农夫看着头大,他决定代入具体鸡兔数值。

鸡→鸡/兔

假设第 k 天, 鸡兔的比例仍为 60%、40%:

$$\boldsymbol{\pi}(k) = \begin{bmatrix} \pi_1(k) \\ \pi_2(k) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.6 \\ 0.4 \end{bmatrix} \tag{17}$$



如图 11 所示, $\pi_1(k)t_1$ 代表"鸡 \rightarrow 鸡/兔"。第 k 天,鸡的比例为 0.6,这些鸡在第 k+1 天变成占 总体比例 0.42 的鸡和 0.18 的兔:

$$\pi_1(k)\mathbf{t}_1 = 0.6 \times \begin{bmatrix} 0.7\\0.3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.42\\0.18 \end{bmatrix} \tag{18}$$

图 12 所示为 (18) 运算热图。

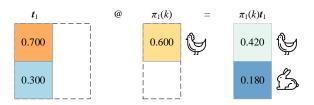


图 12. 第 $k \to$ 第 $k + 1 \to$,鸡 \rightarrow 鸡/兔

兔→鸡/兔

如图 13 所示, $\pi_2(k)t_2$ 代表"兔 \rightarrow 鸡/兔"。第 k 天,兔的比例为 0.4,这些兔在第 k+1 天变成占总体比例 0.08 的鸡和 0.32 的兔:

$$\pi_2(k)\mathbf{t}_2 = 0.4 \times \begin{bmatrix} 0.2\\0.8 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.08\\0.32 \end{bmatrix} \tag{19}$$

图 14 热图对应上述运算。

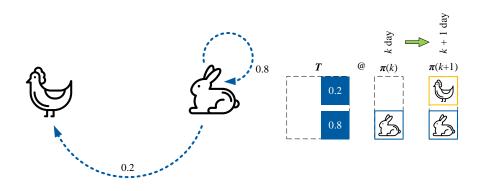


图 13. 兔→鸡/兔

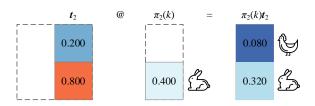


图 14. 第 $k \to$ 第 $k + 1 \to$,兔 \rightarrow 鸡/兔

如图 15 热图所示,将 (18) 和 (19) 相加,得到第 k+1 天状态向量 $\pi(i+1)$:

$$\pi(k+1) = \begin{bmatrix} 0.42 \\ 0.18 \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} 0.08 \\ 0.32 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.5 \\ 0.5 \end{bmatrix} \tag{20}$$

本 PDF 文件为作者草稿,发布目的为方便读者在移动终端学习,终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。版权归清华大学出版社所有,请勿商用,引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载: https://github.com/Visualize-ML

本书配套微课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger: https://space.bilibili.com/513194466

欢迎大家批评指教,本书专属邮箱: jiang.visualize.ml@gmail.com

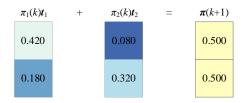


图 15. 第 $k \to 3$ 第 k + 1 天,鸡/兔→鸡/兔

这就是利用矩阵乘法第二视角来分析状态转化运算。

25.4 连续几夜鸡兔转换

农夫把自己所学所想和村民分享后,大家都觉得线性代数有趣,认为农夫的分析有道理。大 家纷纷加入农夫成立的"线代探秘小组",学线代、用线代,并继续探究鸡兔互变这个疑难杂症。

有"线代探秘小组"成员发现,虽然连日来各家鸡兔互变没有停止,但是全村的鸡兔比例似乎 达到了某种平衡。真是丈二和尚摸不着头脑!

农夫想用线性代数方法来看看连续几晚鸡兔互变有何有趣特征。

第 0 天,为初始状态,记做 $\pi(0)$ 。

第1天, 状态向量 π(1) 为:

$$0 \to 1: \quad T\pi(0) = \pi(1) \tag{21}$$

第 2 天, 状态向量 $\pi(2)$ 和 $\pi(0)$ 关系为:

$$0 \to 2: \quad T\pi(1) = T^2\pi(0) = \pi(2) \tag{22}$$

第 3 天, 状态向量 $\pi(3)$ 和 $\pi(0)$ 关系为:

$$0 \to 3: \quad T\pi(2) = T^3\pi(0) = \pi(3) \tag{23}$$

这样 $0 \rightarrow k$ 变化过程可以写成:

$$0 \to k: \quad T^k \pi(0) = \pi(k) \tag{24}$$

12 夜

农夫想算算连续 12 夜,在不同鸡兔初始比例状态 $\pi(0)$ 条件下,鸡兔达到平衡时比例特点。

图 16 所示的五种情况为鸡的初始比例更高,经过连续 12 夜的变化,农夫发现鸡兔的比例都达到了 40%、60%,也就是 4:6。

这个结果让农夫和"线代探秘小组"组员都眼前一亮!

而图 17 对应的一种情况是,鸡兔的初始比例相同,都是 50%; 12 夜之后,鸡兔比例还是 40% 、60% 。

图 18 所示的五种情况是,初始状态 $\pi(0)$ 时,兔的比例更高。有趣的是,12 夜之后,鸡兔比例最终还是达到 40%、60%。

农夫觉得可以初步得出结论,在给定的转移矩阵 T 前提下,不管鸡兔初始比例 $\pi(0)$ 如何,结果都达到了一定的平衡,也就是:

| $T\pi = \pi \tag{25}$ |
|-----------------------|
|-----------------------|

| $\pi(0)$ | π (1) | π (2) | π (3) | π (4) | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | π (8) | π (9) | π (10) | $\pi(11)$ | $\pi(12)$ |
|----------|--------------|--------------|--------------|--------------|----------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-----------|
| 1.000 | 0.700 | 0.550 | 0.475 | 0.437 | 0.419 | 0.409 | 0.405 | 0.402 | 0.401 | 0.401 | 0.400 | 0.400 |
| 0.000 | 0.300 | 0.450 | 0.525 | 0.563 | 0.581 | 0.591 | 0.595 | 0.598 | 0.599 | 0.599 | 0.600 | 0.600 |
| | | | | | | | | | | | | |
| $\pi(0)$ | π (1) | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | $\pi(4)$ | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | π (8) | π (9) | $\pi(10)$ | $\pi(11)$ | $\pi(12)$ |
| 0.900 | 0.650 | 0.525 | 0.462 | 0.431 | 0.416 | 0.408 | 0.404 | 0.402 | 0.401 | 0.400 | 0.400 | 0.400 |
| 0.100 | 0.350 | 0.475 | 0.538 | 0.569 | 0.584 | 0.592 | 0.596 | 0.598 | 0.599 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |
| | | | | | | | | | | | | |
| $\pi(0)$ | $\pi(1)$ | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | $\pi(4)$ | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | $\pi(8)$ | π (9) | $\pi(10)$ | π (11) | $\pi(12)$ |
| 0.800 | 0.600 | 0.500 | 0.450 | 0.425 | 0.412 | 0.406 | 0.403 | 0.402 | 0.401 | 0.400 | 0.400 | 0.400 |
| 0.200 | 0.400 | 0.500 | 0.550 | 0.575 | 0.588 | 0.594 | 0.597 | 0.598 | 0.599 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |
| | | | | | | | | | | | | |
| $\pi(0)$ | $\pi(1)$ | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | $\pi(4)$ | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | $\pi(8)$ | π (9) | $\pi(10)$ | π (11) | $\pi(12)$ |
| 0.700 | 0.550 | 0.475 | 0.438 | 0.419 | 0.409 | 0.405 | 0.402 | 0.401 | 0.401 | 0.400 | 0.400 | 0.400 |
| 0.300 | 0.450 | 0.525 | 0.562 | 0.581 | 0.591 | 0.595 | 0.598 | 0.599 | 0.599 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |
| | | | | | | | | | | | | |
| $\pi(0)$ | π (1) | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | $\pi(4)$ | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | π (8) | π (9) | π (10) | π (11) | $\pi(12)$ |
| 0.600 | 0.500 | 0.450 | 0.425 | 0.412 | 0.406 | 0.403 | 0.402 | 0.401 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 |
| 0.400 | 0.500 | 0.550 | 0.575 | 0.588 | 0.594 | 0.597 | 0.598 | 0.599 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |

图 16. 连续 12 夜鸡兔互变比例,鸡的初始比例更高

本 PDF 文件为作者草稿,发布目的为方便读者在移动终端学习,终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。版权归清华大学出版社所有,请勿商用,引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载: https://github.com/Visualize-ML

本书配套微课视频均发布在B站——生姜 DrGinger: https://space.bilibili.com/513194466

欢迎大家批评指教,本书专属邮箱: jiang.visualize.ml@gmail.com

| $\pi(0)$ | $\pi(1)$ | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | $\pi(4)$ | $\pi(5)$ | π (6) | $\pi(7)$ | $\pi(8)$ | π (9) | $\pi(10)$ | π (11) | $\pi(12)$ |
|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-----------|----------|----------|--------------|-----------|---------------|-----------|
| | | | 0.412 | | | | | | | | | |
| 0.500 | 0.550 | 0.575 | 0.588 | 0.594 | 0.597 | 0.598 | 0.599 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |

图 17. 连续 12 夜鸡兔互变比例,鸡和兔的初始比例一样高

| $\pi(0)$ | $\pi(1)$ | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | $\pi(4)$ | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | π (8) | π (9) | $\pi(10)$ | $\pi(11)$ | $\pi(12)$ |
|----------|--------------|----------|----------|--------------|----------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-----------|
| 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 |
| 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |
| | | | | | | | | | | | | |
| $\pi(0)$ | π (1) | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | π (4) | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | π (8) | π (9) | π (10) | π (11) | $\pi(12)$ |
| 0.300 | 0.350 | 0.375 | 0.387 | 0.394 | 0.397 | 0.398 | 0.399 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 |
| 0.700 | 0.650 | 0.625 | 0.613 | 0.606 | 0.603 | 0.602 | 0.601 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |
| | | | | | | | | | | | | |
| $\pi(0)$ | π (1) | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | π (4) | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | π (8) | π (9) | $\pi(10)$ | $\pi(11)$ | $\pi(12)$ |
| 0.200 | 0.300 | 0.350 | 0.375 | 0.387 | 0.394 | 0.397 | 0.398 | 0.399 | 0.400 | 0.400 | 0.400 | 0.400 |
| 0.800 | 0.700 | 0.650 | 0.625 | 0.613 | 0.606 | 0.603 | 0.602 | 0.601 | 0.600 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |
| | | | | | | | | | | | | |
| $\pi(0)$ | π (1) | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | π (4) | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | π (8) | π (9) | $\pi(10)$ | π (11) | $\pi(12)$ |
| 0.100 | 0.250 | 0.325 | 0.362 | 0.381 | 0.391 | 0.395 | 0.398 | 0.399 | 0.399 | 0.400 | 0.400 | 0.400 |
| 0.900 | 0.750 | 0.675 | 0.638 | 0.619 | 0.609 | 0.605 | 0.602 | 0.601 | 0.601 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |
| | | | | | | | | | | | | |
| $\pi(0)$ | π (1) | $\pi(2)$ | $\pi(3)$ | $\pi(4)$ | $\pi(5)$ | π (6) | π (7) | π (8) | π (9) | π (10) | π (11) | $\pi(12)$ |
| 0.000 | 0.200 | 0.300 | 0.350 | 0.375 | 0.388 | 0.394 | 0.397 | 0.398 | 0.399 | 0.400 | 0.400 | 0.400 |
| 1.000 | 0.800 | 0.700 | 0.650 | 0.625 | 0.613 | 0.606 | 0.603 | 0.602 | 0.601 | 0.600 | 0.600 | 0.600 |

图 18. 连续 12 夜鸡兔互变比例,兔的初始比例更高

求解平衡状态

农夫把 (25) 代入 (4), 得到:

$$\begin{bmatrix} p & q \\ 1-p & 1-q \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \pi_1 \\ \pi_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \pi_1 \\ \pi_2 \end{bmatrix}$$
 (26)

另外, 状态向量本身元素相加为1, 由此农夫得到两个等式:

本 PDF 文件为作者草稿,发布目的为方便读者在移动终端学习,终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。版权归清华大学出版社所有,请勿商用,引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载: https://github.com/Visualize-ML

本书配套微课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger: https://space.bilibili.com/513194466

欢迎大家批评指教,本书专属邮箱: jiang.visualize.ml@gmail.com

$$\begin{cases} p\pi_1 + q\pi_2 = \pi_1 \\ \pi_1 + \pi_2 = 1 \end{cases}$$

$$(27)$$

求解二元一次线性方程组得到:

$$\begin{cases}
\pi_{1} = \frac{q}{1 - p + q} \\
\pi_{2} = \frac{1 - p}{1 - p + q}
\end{cases}$$
(28)

农夫记得他假设 p = 0.7, q = 0.2, 代入 (28) 得到:

$$\begin{cases}
\pi_1 = 0.4 \\
\pi_2 = 0.6
\end{cases}$$
(29)

也就鸡兔互变平衡时. 稳态向量 π 为:

$$\boldsymbol{\pi} = \begin{bmatrix} \pi_1 \\ \pi_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.4 \\ 0.6 \end{bmatrix} \tag{30}$$

这和农夫之前做的模拟实验结果完全一致!真可谓"山重水复疑无路,柳暗花明又一村。" 也就是说,T乘上(30)中的稳态向量 π ,结果还是稳态向量 π :

$$T\pi = \pi \quad \Rightarrow \quad \underbrace{\begin{bmatrix} 0.7 & 0.2 \\ 0.3 & 0.8 \end{bmatrix}}_{T} \begin{bmatrix} 0.4 \\ 0.6 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.4 \\ 0.6 \end{bmatrix}$$
(31)

农夫突然记起这就是前几日他读到的特征值分解 (eigen decomposition)! 书上反复提到特征值 分解的重要性,农夫今天也见识到这个数学利器的伟力。



Bk3 Ch25 2.py 绘制本节 11 幅热图。



在 Bk3 Ch25 2.py 基础上, 我们做了一个 App 用热图展示不同的初始状态到稳态向量的 演变过程。请参考 Streamlit Bk3 Ch25 2.py。

25.5 有向量的地方,就有几何

农夫学习线性代数时,总结了几句真经。其中一句就是——有向量的地方,就有几何。 他决定透过几何这个视角来看看状态向量的变化。

本 PDF 文件为作者草稿,发布目的为方便读者在移动终端学习,终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。 版权归清华大学出版社所有,请勿商用,引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载: https://github.com/Visualize-ML

本书配套微课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger: https://space.bilibili.com/513194466

欢迎大家批评指教,本书专属邮箱: jiang.visualize.ml@gmail.com

农夫把图 16、图 17、图 18 对应的 11 种状态向量的初始值画在平面直角坐标系中,用"有方向的 线段"代表具体向量数值。

在他画的 \mathbb{R} 19 这 11 幅子图中,紫色向量代表鸡兔初始比例状态 $\pi(0)$,红色向量代表经过 12 夜鸡兔互变后 $\pi(12)$ 的位置。

农夫发现不管初始比例状态 $\pi(0)$ 如何,也就是紫色向量位于任何方位,经过 12 夜持续变 化, 红色向量 $\pi(12)$ 的位置几乎完全一致。

特别地,如图19(g)所示,当初始比例π(0)就是稳态向量时:

$$\pi(0) = \begin{bmatrix} 0.4\\0.6 \end{bmatrix} \tag{32}$$

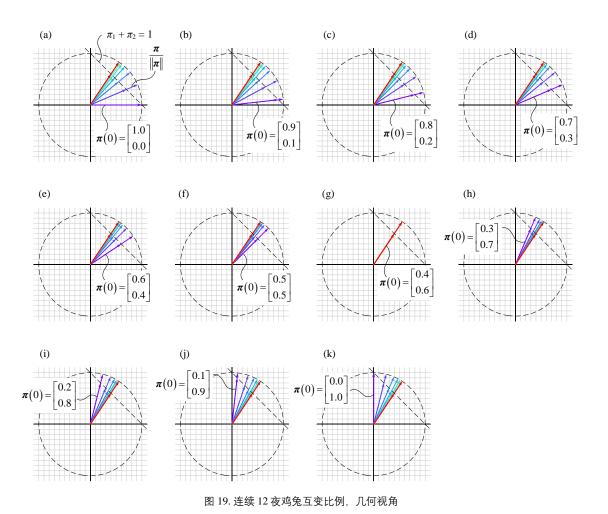
转移矩阵 T 没有改变 $\pi(0)$ 的方向。农夫查阅典籍发现,这个向量也有自己的名字,它叫做 T的特征向量 (eigenvector)。

而且,他发现变化过程,向量终点都落在一条直线上。这条直线代表——鸡、兔比例之和为 1。

农夫在图 19 中还画了另外一组向量,这些向量都是单位向量 (unit vector),对应:

$$\frac{\pi}{\|\pi\|}\tag{33}$$

这一组向量终点都落在单位圆上,因为它们的模都是1。





Bk3 Ch25 3.py 绘制图19。



在 Bk3_Ch25_3.py 基础上,我们做了一个 App 用箭头图展示不同的初始状态到稳态向量的演变过程。请参考 Streamlit Bk3 Ch25 3.py。

25.6 彩蛋

至此,小村村民心中一块大石头算是落地了。对于"鸡兔互变"这个奇事,大伙儿也都见怪不怪了!

本 PDF 文件为作者草稿,发布目的为方便读者在移动终端学习,终稿内容以清华大学出版社纸质出版物为准。版权归清华大学出版社所有,请勿商用,引用请注明出处。

代码及 PDF 文件下载: https://github.com/Visualize-ML

本书配套徽课视频均发布在 B 站——生姜 DrGinger: https://space.bilibili.com/513194466

欢迎大家批评指教,本书专属邮箱: jiang.visualize.ml@gmail.com

前后脚的事儿,村民发现鸡兔互变也停了。笑容在大伙儿脸上绽开,农夫把全村老少都邀到 自家菜园,要好好欢庆一番!

大伙儿都没闲着,摘果蔬、网肥鱼、蒸米饭、取美酒、摆桌椅、嘉宾纷沓、鼓瑟吹笙、烹羊 宰牛且为乐, 会须一饮三百杯 ...

这阵仗吓坏了的一笼鸡兔,它们蜷缩一团,瑟瑟发抖。农夫见状,撸着一只毛绒兔耳朵说, "你们这次立了大功, 留着过年吧!"

欢言酌春酒、摘我园中蔬。微雨从东来、好风与之俱。

变与不变

书到用时方恨少,腹有诗书气自华,农夫这次让大伙儿理解了这两句话的精髓。

经过这场线性代数风暴之后,小村村民白天田间耕作时都会怀揣一本数学典籍,一得片刻休 息,大伙儿分秒必争、手不释卷。夜深人静时,焚膏继晷、挑灯夜读者甚多。学数学,用数学, 成了小村新风尚。

大伙儿似乎也不再惧怕未知,因为"我们必须知道,我们终将知道。"

渐渐地,这个曾经与世隔绝的小村处处都在变化,村民们也都肉眼可见地变化。你让我说, 小村和村民哪里发生了变化?我也说不上。反正,时时刻刻都在变化,感觉一切都在变得更好。

而不变的是,小村还是那个小村,村民还是咱们这五十几户村民。

云山青青,风泉泠泠。山色依旧可爱,泉声更是可听。

(镜头拉远拉高) 一川松竹任横斜, 有人家, 被云遮。



东风升, 云雾腾。

紫气东来, 祥云西至。

鸡兔同笼引发的思想风暴,似乎给这个沉睡数百年的村庄带了什么,也似乎带走了什么。

好像什么都没有发生,又好像要发生什么。

往时曾发生的, 来日终将发生。