

Appunti dal corso Introduzione ai Sistemi Complessi

Grufoony

8 novembre 2021

1 Sistema Complesso

Definizione 1.1. *Sistema Complesso è un sistema dinamico composto da sottosistemi interagenti tra loro.*

Per lo studio di un sistema complesso si usa solitamente un approccio olistico, ossia studiando prevalentemente le proprietà macroscopiche del sistema totale, senza considerare i singoli sottosistemi. Un'osservazione importante che va effettuata è che un sistema complesso **prevede**, non descrive. Alcune delle proprietà principali sono:

- **complessità:** presenza di molti d.o.f. (molti sottosistemi)
- **proprietà emergenti:** derivano dal grande numero di sottosistemi. Ad esempio possiamo definire *fluida* un insieme di molte particelle ma la particella singola non può essere fluida.
- **autorganizzazione:** i sistemi complessi sono ibridi, ossia metà stocastici e metà deterministici. Per studiarli devo dare ugual peso a entrambi gli aspetti.

2 Distribuzioni

Vediamo ora una serie di distribuzioni e teoremi ad esse legati che ci aiuteranno nell'analisi dei sistemi.

Definizione 2.1.

- *Gaussiana*
$$\rho(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma} e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}$$
- *Esponenziale*
$$\rho(x) = \frac{1}{k} e^{-\frac{x}{k}}$$
- *Potenza*
$$\rho(x) \propto \frac{1}{x^a}, \text{ con } a > 0$$

Definizione 2.2. *Momenti di una distribuzione:*

$$\langle x^k \rangle = \int_{-\infty}^{+\infty} x^k \rho(x) dx$$

Teorema 2.1. *Invarianza di scala:*

se $\rho(x) \propto \frac{1}{x^a}$ allora posto $y = \lambda x$ si ha $\rho(y) = \frac{\lambda^a}{x^a} \propto \frac{1}{y^a}$

Teorema 2.2. *Limite centrale:*

Siano x_k variabili casuali indipendenti, allora:

$$\lim_{N \rightarrow \infty} z = \frac{1}{\sqrt{N}} \sum_{k=1}^N x_k = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma}} e^{-\frac{z^2}{2\sigma^2}}$$

Ora possiamo dare una definizione di probabilità:

Definizione 2.3. *Probabilità:*

$$p(x \in [a, b]) = \int_a^b \rho(x) dx$$

Definizione 2.4. *Probabilità cumulata:*

$$p(x \leq a) = \int_{-\infty}^a \rho(x) dx$$

3 Informazione ed entropia

Definizione 3.1. Una variabile x a valori discreti $\{x_0, x_1, \dots\}$ è detta variabile di CODING

Considerando una sequenza (codifica) $\{x_k\}_1^N$ si può assumere $P(\{x_k\}) = p(x_1) \dots p(x_N)$. Una codifica è detta **ottimale** se può descrivere in maniera univoca un'orbita.

Definizione 3.2. $-\ln(x)$ informazione portata dal carattere x

Definizione 3.3. $S = -\sum_k p(x_k) \ln(p(x_k))$ entropia di informazione (informazione media portata dalle variabili x_k)

Si nota subito come più un valore della variabile di coding è probabile, minor informazione questo porti. Informaticamente, la misura è circa il numero di bit necessari per memorizzare la sequenza. Non bisogna confondere entropia con informazione: la variabile deve avere un significato!

Teorema 3.1. *legge dei grandi numeri*

Siano A e B due eventi distinti (osservati N volte), allora si ha che

$$\lim_{N \rightarrow \infty} \frac{p(AB)}{p(A)} = p(B/A)$$

Per capire la sequenza bisogna conoscerne la *memoria*, ossia tutte le dipendenze di un evento dagli altri. L'*irreversibilità* di un evento si ha quando la coppia di eventi AB è diversa dalla coppia di eventi BA .

Definizione 3.4. $p_{ij} = p(x_j/x_i)$ matrice stocastica

La matrice stocastica ha per definizione le seguenti proprietà:

- $0 \leq p_{ij} \leq 1$
- $\sum_j p_{ij} = 1$

Si consideri ora una sequenza infinita e sia p_i la probabilità di avere l'elemento x_i in quella posizione. Qual è la probabilità p_j di avere l'elemento successivo? Sia n il numero di passi per arrivare in posizione i , allora:

$$p_j^{n+1} = \sum_i p_{ij} p_j^n \quad (1)$$

Risulta quindi utile il seguente teorema:

Teorema 3.2. *Esiste un autovettore con autovalore $\lambda_0 = 1$, ossia $p_j^s = \sum_i p_{ij} p_j^s$*

Corollari:

- è un vettore stazionario situato nel primo quadrante
- gli iperpiani sono invarianti per p_{ij}
- $\lambda_i < 1 \quad \forall i \neq 0$
- $p_j^{n+1} = \sum_i p_{ij} p_j^n = 1 \Leftrightarrow \sum_i p_i^n = 1$

A questo punto si può calcolare come cambi l'entropia di informazione di una catena aggiungendo un carattere.

Definizione 3.5. *Proprietà di Markov (di tempo presente)*

$$P(\{x_1, \dots, x_{n+1}\}) = P(x_{n+1}/P x_n) P(\{x_1, \dots, x_n\})$$

Si può quindi scrivere l'entropia dell'($N+1$)esimo passo come:

$$S_{N+1} = S_N - \sum_{ij} p_j^s p_{ij} \ln p_j \quad (2)$$

Questa entropia fornisce un'importante risultato sulla reversibilità del processo: se invertendo il tempo non ho differenza di entropia, allora il processo è *reversibile*, altrimenti no. Le **fluttuazioni** di un sistema **all'equilibrio** sono sempre un processo **reversibile**, infatti osservando tale sistema non si riesce a distinguere tra passato e futuro. Come esempio per giustificare la precedente affermazione si può prendere un pendolo fisico in assenza di attriti/forse esterne, oppure un *moto browniano*.

Definizione 3.6. *Struttura di catena.*

Un modello ha struttura di catena quando il flusso in una direzione implica un secondo flusso nella direzione opposta.

4 Costruzione di un modello

Punto fondamentale di un sistema complesso è costruire un modello matematico che riesca a riprodurre le sue caratteristiche fondamentali, per poi studiarlo. La prima cosa da definire è l'*ambiente* in cui ci troviamo. Questo può essere neutro o avere caratteristiche, ad esempio una distribuzione di nutrimento (per sistemi biologici). Altro punto fondamentale è definire *spazio e tempo*. Spesso non fa differenza la scelta di spazi e tempi discreti rispetto ai continui, quindi è preferibile assumere una discretizzazione iniziale per poi passare al continuo successivamente. Una volta definito lo spazio bisogna poi decidere le condizioni al contorno, ossia il comportamento ai bordi. Posso a questo punto avere *barriere* di tre tipi:

- **riflettenti**, dove ho un bordo *non* oltrepassabile. Si crea quindi un fenomeno di **attrattività delle pareti**.
- **periodico**, dove ho i bordi coincidenti (esco da una parte e rientro dall'altra). Lo spazio assume in questo caso una forma toroidale.
- **assorbenti**, dove gli oggetti "uscenti" vengono distrutti. In questo caso bisogna di introdurre delle *sorgenti* nel modello per evitare di perdere tutti i soggetti.

Si nota facilmente come più piccolo sia il modello, più importante sia il contributo degli effetti di bordo.

Nella maggior parte dei sistemi non tutti i soggetti hanno le stesse caratteristiche: si definiscono allora **classi** di appartenenza, legate tra loro da relazioni matematiche.

4.1 Random Walk 1D

Il modello più basilare di sistema complesso è sicuramente la random walk su una retta, ossia un punto che ogni istante di tempo decide in maniera casuale se spostarsi a destra o a sinistra. Sia $p = \frac{1}{2}$ la probabilità di muoversi verso destra (quindi anche a sinistra) di un passo Δx . Si hanno:

- {R}: $p(t + \Delta t) = x(t) + \Delta x$
- {L}: $p(t + \Delta t) = x(t) - \Delta x$

Dopo n passi si ha quindi $p(n\Delta t) = x_0 + \sum_k \xi_k \Delta x$ con $\xi(t) = \pm 1$. Inoltre si può verificare che $\langle \xi_k \rangle = 0$, $\langle \xi_k^2 \rangle = 1$, $\langle \xi_k \xi_h \rangle = \langle \xi_k \rangle \langle \xi_h \rangle$, $k \neq h$. Per il teorema del limite centrale si ha: $\sum_k \xi_k \Delta x = \sqrt{n\Delta t} \left(\frac{1}{\sqrt{n}} \sum_k \xi_k \right) \frac{\Delta x}{\sqrt{\Delta t}} = \frac{1}{\sqrt{2\pi Dt}} e^{-\frac{z^2}{2Dt}}$, con z variabile gaussiana. Introducendo il concetto di diffusione:

Definizione 4.1. *Diffusione.* $D = \frac{\Delta x^2}{\Delta t}$

si può descrivere l'evoluzione del sistema come $x(t) = x_0 + z\sqrt{Dt}$. Si utilizza \sqrt{n} per normalizzare in quanto è l'unico esponente non divergente. La varianza della gaussiana cresce nel tempo, infatti calcolando i momenti della distribuzione

si trova $\langle x(t) \rangle = x_0$, $\langle (x(t) - x_0)^2 \rangle = Dt$. Se la topologia del sistema fosse una circonferenza (e non una retta), si avrebbe un rilassamento esponenziale a una situazione stazionaria.

4.2 Random Walk 2D

Volendo espandere il modello di random walk ad uno spazio 2D si nota subito come, essendo ogni asse indipendente dall'altro, si possa semplicemente comporre due gaussiane:

$$(x, y) \simeq \frac{1}{2\pi\Delta t} e^{-\frac{x^2+y^2}{2\Delta t}} = \rho(x, y, t) \quad (3)$$

Dove la diffusione segue la definizione precedente ed è la stessa in tutte le direzioni. La funzione $\rho(x, y, t)$ rappresenta di fatto la probabilità che la il soggetto in analisi si trovi in un volume $\Delta x \Delta y$. Si può riscrivere la relazione precedente in coordinate polari ottenendo:

$$\rho(r, \theta, t) = \frac{r}{2\pi\Delta t} e^{-\frac{r^2}{2\Delta t}} \quad (4)$$

studiando più semplicemente l'allontanamento dall'origine. In particolare, l'allontanamento medio risulta:

$$\langle r \rangle = \int_0^\infty \rho(r, \theta, t) r dr = \sqrt{\frac{\pi}{2}\Delta t} \quad (5)$$

e la densità diminuisce quindi esponenzialmente.

4.3 Modello Economico

Si vuole ora costruire un primo modello legato alla realtà simulando, per quanto grossolanamente, l'economia globale.

Supponiamo di avere M individui con n soldi ciascuno, che si muovono su una griglia secondo una Random Walk 2D. Ogni qualvolta due individui si trovino sulla stessa cella questi si scambiano 1 soldo con probabilità $p = \frac{1}{2}$.

Caso limite: se si incontra un povero ($n = 0$), si gioca lo stesso (gioco scorretto) per permettere a tutti di uscire dalla povertà. Il sistema ha quindi i seguenti limiti:

$$\begin{cases} \sum_k n_k = N \\ n_k \geq 0 \end{cases} \quad (6)$$

con N costante, quindi non si ha creazione/distruzione di denaro. La probabilità di trovare un individuo con n soldi è:

$$p(n) = \frac{\binom{M+N-2-n}{M-2}}{\binom{M+N-1}{N-1}} \quad (7)$$

e, ponendo $\bar{n} = \frac{N}{M}$, si può calcolare:

$$\lim_{M \rightarrow \infty} \frac{1}{\bar{n}} \left(1 - \frac{n}{M}\right)^M = \frac{1}{\bar{n}} e^{-\frac{n}{\bar{n}}} \quad (8)$$

quindi la probabilità decresce esponenzialmente.

Il modello prevede quindi:

- molti poveri e pochi ricchi (ma praticamente nessun super-ricco)
- esiste un tempo in cui un povero diventa ricco (e viceversa)
- simile alla distribuzione di energia di Maxwell-Boltzmann
- se chi è ricco pagasse di più si otterrebbe una curva a campana

Tuttavia osservando i dati sperimentali si nota una discrepanza: nella realtà la probabilità sembra seguire una legge a potenza piuttosto che esponenziale.

4.4 Modello Economico Evoluto

Per adattare il modello precedente alla realtà si introduce una microdinamica sugli scambi di denaro.

Sia π_{\pm} la probabilità di guadagnare ± 1 soldi se un soggetto ne possiede n . All'equilibrio si deve avere:

$$\pi_+(n-1)p(n-1) + \pi_-(n+1)p(n+1) = \pi_+(n)p(n) + \pi_-(n)p(n) \quad (9)$$

e in particolare è verificato il *bilancio dettagliato*:

$$\pi_+(n-1)p(n-1) = \pi_-(n)p(n) \quad \forall n \geq 1 \quad (10)$$

Normalizzata la distribuzione è possibile iterare il tutto:

$$p(n) = \prod_{k=1}^n \frac{\pi_+(k-1)}{1p_-(k)} p(0) \quad (11)$$

Riscrivendo un maniera più comoda il bilancio dettagliato, si può poi procedere:

$$\pi_+(n - \frac{1}{2})p(n - \frac{1}{2}) = \pi_-(n + \frac{1}{2})p(n + \frac{1}{2}) \quad (12)$$

$$\begin{aligned} [\pi_+(n) - \pi_-(n)]p(n) - \frac{1}{2} \frac{\partial}{\partial n} [\pi_+(n) - \pi_-(n)]p(n) &\simeq 0 \\ ap(n) + \frac{\partial}{\partial n} (bn)p(n) &\simeq 0 \end{aligned} \quad (13)$$

Si possono notare ora le seguenti dipendenze:

$$\begin{cases} \pi_+(n-1) - \pi_-(n) \simeq a \\ \pi_+(n) \simeq bn - \frac{a}{2} \\ \pi_-(n) \simeq bn + \frac{a}{2} \end{cases} \quad (14)$$

Cercando ora l'andamento di $p(n)$:

$$\begin{aligned}
 p(n) - p(n-1) &= \left(\frac{bn - \frac{a}{2}}{bn + \frac{a}{2}} - 1 \right) p(n-1) \\
 \frac{dp}{dn} &= -\frac{a}{bn} p(n-1) \\
 \Rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} p(n) &\propto n^{-\frac{a}{b}}
 \end{aligned} \tag{15}$$

si ottiene esattamente l'andamento a potenza ricercato.

4.5 La rovina di un giocatore

Consideriamo un giocatore d'azzardo con a disposizione un capitale k e che vuole arrivare ad un capitale M . Il gioco finisce ai "bordi" per $k = 0$ (giocatore rovinato) o per $k = M$ (giocatore felice). Siano p la probabilità di guadagnare, $q = 1 - p$ la probabilità di perdere, $P_M(k)$ la probabilità di arrivare al capitale M partendo da k . Come nel modello economico evoluto si ha:

$$P_M(k) = pP_M(k+1) + qP_M(k-1) \tag{16}$$

con i vincoli

$$\begin{cases} P_M(0) = 0 \\ P_M(M) = 1 \end{cases} \tag{17}$$

Ragionando per induzione si ottiene:

$$P_M(k+1) - P_M(k) = \frac{q}{p} [P_M(k) - P_M(k-1)] = \left(\frac{q}{p} \right)^k P_M(1) \tag{18}$$

$$P_M(k) = \frac{1 - \left(\frac{q}{p} \right)^k}{1 - \left(\frac{q}{p} \right)^M} \tag{19}$$

Ponendo ora $p > q$,

$$P_\infty(k) = 1 - \left(\frac{q}{p} \right)^k \tag{20}$$

In particolare, considerando un gioco equo, si può notare come $P_M(k) = \frac{k}{M}$ e quindi:

- il gioco è alla pari solo se $k \simeq M$
- la probabilità di vincita aumenta all'aumentare del proprio capitale rispetto a quello avversario
- contro un casinò ($M \rightarrow \infty$) la probabilità di vincita è evidentemente nulla anche in caso di gioco equo (assunzione oltretutto inverosimile)