Στοχαστικές Διαδικασίες
1ή Θεωρητική Άσκηση

Λεωνίδας Αβδελάς | ΑΜ: 03113182

Άσκηση 4

Έχουμε τον πίνακα:

$$P = \begin{pmatrix} 0 & 3/4 & * & 0 & 0 \\ 3/4 & 0 & 0 & 1/8 & * \\ 1/2 & 1/4 & 1/4 & * & * \\ * & 3/5 & 1/5 & 1/5 & * \\ 0 & 0 & 1/10 & 1/5 & * \end{pmatrix}$$

Για να είναι ο πίνακας πίνακας πιθανοτήτων μετάβασης, θα πρέπει για κάθε $p(i,j)$ να ισχύει $\sum_j p(i,j) = 1$.

Άρα για την πρώτη γραμμή: $0 + \frac{3}{4} + * + 0 + 0 = 1$, οπότε $* = \frac{1}{4}$.

Για την δεύτερη γραμμή: $\frac{3}{4} + 0 + 0 + \frac{1}{8} + * = 1$, οπότε $* = \frac{1}{8}$.

Για την τρίτη γραμμή: $\frac{1}{2} + \frac{1}{4} + \frac{1}{4} + * + * = 1$, οπότε και για τα δύο $* = 0$.

Για την τέταρτη γραμμή: $* + \frac{3}{5} + \frac{1}{5} + \frac{1}{5} + * = 1$, οπότε και για τα δύο $* = 0$.

Για την πέμπτη γραμμή: $0 + 0 + \frac{1}{10} + \frac{1}{5} + * = 1$, οπότε $* = 7/10$.

Άσκηση 5

Δεδομένου ότι ο χώρος καταστάσεων είναι $\mathbb{X} = \{K, B, \Sigma, Y, M\}$, ο πίνακς πιθανοτήτων μετάβασης θα είναι:

$$P = \begin{pmatrix} 0 & 1/2 & 1/2 & 0 & 0 \\ 1/2 & 0 & 1/2 & 0 & 0 \\ 1/4 & 1/4 & 0 & 1/4 & 1/4 \\ 0 & 0 & 1/2 & 0 & 1/2 \\ 0 & 0 & 1/2 & 1/2 & 0 \end{pmatrix}$$

Άσκηση 6

Θέλουμε να μοντελοποιήσουμε την θέση του ρήγα, άρα ο χώρος καταστάσεων μας θα είναι $\mathbb{X} = \{\Theta_1, \Theta_2, \Theta_3, \Theta_4, \Theta_5\}$.

Θα μελετήσουμε την θέση του ρήγα περιγραφικά πρώτα και μετά θα φτιάξουμε τον πίνακα πιθανοτήτων μετάβασης.

Αν είναι στην θέση Θ_1, έχει πιθανότητα να βρεθέι στην μέση $2/3$. Ακόμα,με πιθανοτήτα $1/3$ μπορεί να επιλεγεί το χαρτί στην Θ_5, οπότε σε αυτή την περίπτωση ο ρήγας μένει στην θέση του.

Αν είναι στην θέση Θ_2, το χαρτί στην Θ_1 έχει πιθανότητα $2/3$ να επιλεχθεί, οπότε σε αυτή την περίπτωση ο ρήγας θα μετακινηθεί στην Θ_1. Αν επιλεχθεί το χαρτί στην Θ_5, ο ρήγας μένει στην θέση του.

Αν είναι στην θέση Θ_3, το χαρτί στην Θ_1 έχει πιθανότητα $2/3$ να επιλεχθεί, οπότε ο ρήγας θα μετακινηθεί στην θέση Θ_2 και το χαρτί από την Θ_1 θα πάει στην Θ_3. Αν επιλεχθεί το χαρτί στην Θ_5, ο ρήγας θα μετακινηθεί στην Θ_4 και το χαρτί από την Θ_5 θα πάει στην Θ_3.

Αν είναι στην θέση Θ_4, το χαρτί στην Θ_1 έχει πιθανότητα $2/3$ να επιλεχθεί, οπότε σε αυτή την περίπτωση ο ρήγας θα μείνει στην θέση του. Αν επιλεχθεί το χαρτί στην Θ_5, ο ρήγας μετακινήται στην Θ_5.

Αν είναι στην θέση Θ_5, έχει πιθανότητα να βρεθέι στην μέση $1/3$. Ακόμα,με πιθανοτήτα $2/3$ μπορεί να επιλεγεί το χαρτί στην Θ_1, οπότε σε αυτή την περίπτωση ο ρήγας μένει στην θέση του.

Τελικά ο πίνακας πιθανοτήτων μετάβασης θα είναι:

$$P = \begin{pmatrix} 1/3 & 0 & 2/3 & 0 & 0 \\ 2/3 & 1/3 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 2/3 & 0 & 1/3 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 2/3 & 1/3 \\ 0 & 0 & 1/3 & 0 & 2/3 \end{pmatrix}$$

Άσκηση 7

Ο χώρος καταστάσεων είναι $\mathbb{X} = \{0, 1, 2, 3, 4, 5\}$. Θέλουμε να φέρουμε 5 φορές συνεχόμενα 6, οπότε η πιθανότητα να πάμε στην επόμενη κατάσταση κάθε φορά είναι $1/6$, ενώ η πιθανότητα να πάμε στην 0, είναι $5/6$. Αν φτάσουμε στην κατάσταση 5, το παιχνίδι τελειώνει, όποτε παραμένουμε στην κατάσταση αυτή.

Άρα ο πίνακας πιθανοτήτων μετάβασης θα είναι:

$$P = \begin{pmatrix} 5/6 & 1/6 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 5/6 & 0 & 1/6 & 0 & 0 & 0 \\ 5/6 & 0 & 0 & 1/6 & 0 & 0 \\ 5/6 & 0 & 0 & 0 & 1/6 & 0 \\ 5/6 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1/6 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Στην περίπτωση που θέλουμε να εμφανιστεί η ακολουθία 65656, θεωρούμε ότι ο χώρος καταστάσεων είναι ο ίδιος και αναπαριστά σε ποιά θέση της ακολουθίας είμαστε.

Τότε κάθε φορά που φέρνουμε 6 ενώ έπρεπε να φέρουμε 5, γυρνάμε στο πρώτο βήμα, ενώ κάθε άλλη φορά στο μηδενικό.

Έτσι, ο πίνακας πιθανοτήτων μετάβασης θα είναι:

$$P = \begin{pmatrix} 5/6 & 1/6 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 4/6 & 1/6 & 1/6 & 0 & 0 & 0 \\ 5/6 & 0 & 0 & 1/6 & 0 & 0 \\ 4/6 & 1/6 & 0 & 0 & 1/6 & 0 \\ 5/6 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1/6 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Άσκηση 8

Για να είναι η $X_{n_{n \in \mathbb{N}}}$ αλυσίδα Markov, θα πρέπει να ισχύει ότι για κάθε $n \in \mathbb{N}$ και κάθε $\upsilon_0, \ldots, \upsilon_{n-1}, x, y \in \mathbb{X}$ Έχουμε

$$\Pr\left[X_{n+1} = y | X_0 = \upsilon_0, \ldots X_{n-1} = \upsilon_{n-1}, X_n = x\right] = \Pr\left[X_{n+1} = y | X_n = x\right]$$

Πράγματι, εύκολα μπορούμε να δούμε ότι η τιμή του X_{n+1} εξαρτάται μόνο από την τιμή του X_n. Ο χώρος καταστάσεων του X είναι$\{0, 1, 2, 3, 4\}$ και κάθε φορά κάνουμε την πράξη:

$$\begin{aligned} &X_{n+1} = (S_n + \text{dice}) \pmod 5 = \\ &(S_n \pmod 5) + \text{dice} \pmod 5)) \pmod 5 = \\ &(X_n + (\text{dice}) \pmod 5)) \pmod 5 \end{aligned}$$

όπου dice είναι το ισοπίθανο γεγονός της ρίψης του ζαριού με χώρο καταστάσεων το $\{1, 2, 3, 4, 5, 6\}$.

Αρα αν $X_n = 0$, τότε ανάλογα με την τιμή της ζαρίας Z έχουμε:

- $Z = 1$, $X_{N+1} = 1$
- $Z = 2$, $X_{N+1} = 2$

- $Z = 3$, $X_{N+1} = 3$
- $Z = 4$, $X_{N+1} = 4$
- $Z = 5$, $X_{N+1} = 0$
- $Z = 6$, $X_{N+1} = 1$

Ομοίως για $X_n = 1$,

- $Z = 1$, $X_{N+1} = 2$
- $Z = 2$, $X_{N+1} = 3$
- $Z = 3$, $X_{N+1} = 4$
- $Z = 4$, $X_{N+1} = 0$
- $Z = 5$, $X_{N+1} = 1$
- $Z = 6$, $X_{N+1} = 2$

Παρόμοια γίνεται και για τα υπόλοιπα X_n.

Έτσι έχουμε τον πίνακα μεταβάσεων:

$$P = \begin{pmatrix} 1/6 & 2/6 & 1/6 & 1/6 & 1/6 \\ 1/6 & 1/6 & 2/6 & 1/6 & 1/6 \\ 1/6 & 1/6 & 1/6 & 2/6 & 1/6 \\ 1/6 & 1/6 & 1/6 & 1/6 & 2/6 \\ 2/6 & 1/6 & 1/6 & 1/6 & 1/6 \end{pmatrix}$$