

Случайные блуждания

Александр Гиль

Аннотация

Заметка основана на лекции прочитанной автором в ???

1 Вероятность и математические ожидания

Подкидывая игральную кость (кубик), с равными шансами мы можем получить 1, 2, 3, 4, 5 или 6 очков. Результат такого *испытания* называется *случайной величиной*. Естественнo предположить что этот результат не зависит от других таких же испытаний.

При увеличении числа испытаний до бесконечности, доля испытаний на которое приходится определённый исход от общего их общего числа стремится к пределу, который называется его *вероятностью*. Поскольку шансы любого из шести исходов равны, вероятность каждого исхода равна $\frac{1}{6}$.

Представим себе, что мы увеличиваем число испытаний до бесконечности и после каждого броска считаем среднее арифметическое полученных случайных величин. Если эта последовательность стремится к определённому числу, то такое число называется *математическим ожиданием* или *средним* случайной величины.

В нашем примере искомое среднее числа очков можно посчитать по формуле

$$1 \cdot \frac{1}{6} + 2 \cdot \frac{1}{6} + 3 \cdot \frac{1}{6} + 4 \cdot \frac{1}{6} + 5 \cdot \frac{1}{6} + 6 \cdot \frac{1}{6} = 3\frac{1}{2}.$$

Действительно, в пределе, на долю каждого исхода 1, 2, 3, 4, 5 и 6 приходится $\frac{1}{6}$ числа всех исходов и значит их среднее арифметическое должно стремиться к левой стороне равенства.

Иначе говоря, для вычисления среднего мы должны вычислить *взвешенную сумму* значений нашей величины для каждого исхода (1, 2, 3, 4, 5 и 6), взяв вероятность каждого исхода ($\frac{1}{6}$) в качестве веса.

В этой заметке мы обсудим способы нахождения вероятностей и средних, в более сложной ситуации.

2 Санкт-Петербургский парадокс

Вообще говоря, может оказаться, что среднее (математическое ожидание), вычисляемое как предел для продлеваемой бесконечно серии испытаний, не существует для данной схемы испытаний. Такое может случиться поскольку

у бесконечной последовательности чисел предельного значения может не существовать.

В наших задачах такого происходить не будет, но мы не будем это строго доказывать.

Популярным примером такой ситуации является так называемый «Санкт-Петербургский парадокс», в котором рассматривается азартная игра с повторяющимся подкидыванием монетки. Игра кончается, как только при очередном подкидывании выпадает орёл, и игрок получает выигрыш в размере 2^n дукатов (где n — номер первого подкидывания с орлом). То есть, он получает 2 дуката если орёл выпадет при первом подкидывании; $4 = 2^2$, если при первом подкидывании выпадет решка, но при втором выпадет орёл; $8 = 2^3$ дуката, если при первом и втором подкидывании выпадет решка, но при третьем выпадет орёл, и так далее.

Какую максимальную цену следует платить игроку за раунд участия в этой игре?

Для ответа на такой вопрос вычисляют средний выигрыш; в данном случае это сумма следующего ряда. В этом ряду слагаемое под номером n — это вероятность окончания раунда на n -ом подкидывании монеты, умноженная на соответствующий выигрыш.

$$\frac{1}{2} \cdot 2 + \left(\frac{1}{2}\right)^2 \cdot 2^2 + \left(\frac{1}{2}\right)^3 \cdot 2^3 + \dots = 1 + 1 + 1 + \dots = \infty.$$

То есть средний выигрыш в такую игру равен бесконечности. Это приводит нас к парадоксальному выводу: *игроку всегда выгодно покупать право на участие в этой игре, какой бы дорогой ни была цена!*

Заметим, что практический вывод о том, что игроку следует платить любую сколь угодно дорогую цену за билет на такую игру сомнителен из-за ограничений реального мира. Например если имущество вашего соперника состоит из 1000 дукатов, то после 9 решек он обанкротится. В этом случае ясно, что в игре может быть максимум 8 подкидываний и средний выигрыш равен

$$\frac{1}{2} \cdot 2 + \left(\frac{1}{2}\right)^2 \cdot 4 + \dots + \left(\frac{1}{2}\right)^8 \cdot 2^8 = 8.$$

То есть за билет на игру не следует платить больше 8 дукатов.

3 Робот Чебуратор на коротком столе

Электромеханическая игрушка «Робот Чебуратор», будучи включенной, через равные интервалы времени делает шаги одинаковой длины налево или направо, с одинаковой вероятностью $\frac{1}{2}$ выбирая между этими двумя направлениями.

Предположим Чебуратор стоит на коротком столе, шагая вправо он чебурахнется со стола, он может шагнуть влево и остаться на столе но он чебурахнется после второго шага налево. Нас интересуют две задачи:

- Какова вероятность того, что он чебурахнется с правого края стола, и какова — что с левого?

- Чему равно среднее число шагов которые сделает робот чтобы чебуранутся?

При этом мы полагаем, что существование требуемых чисел в обоих вопросах обосновано (это действительно верно, хотя требует доказательства). Поэтому нам остаётся лишь найти численное значение этих чисел.

Решение первой задачи. Пусть p_1 и p_2 обозначают вероятность чебураханья направо из первого и второго положения. Заметим, что

$$p_1 = \frac{1}{2} \cdot 0 + \frac{1}{2} \cdot p_2.$$

Действительно, после первого шага с вероятностью $\frac{1}{2}$ робот чебурахнется налево, и значит шансов чебурахнуться направо у него уже не будет, отсюда слагаемое $0 = \frac{1}{2} \cdot 0$, и с той же вероятностью он перейдёт на второе место, откуда у него будет вероятность p_2 чебурахнуться вправо, отсюда слагаемое $\frac{1}{2} \cdot p_2$.

Аналогично получаем уравнение

$$p_2 = \frac{1}{2} \cdot p_1 + \frac{1}{2} \cdot 1.$$

Эти два уравнения говорят что в последовательности из четырёх чисел,

$$0, p_1, p_2, 1,$$

каждое является средним арифметическим своих соседей. Иначе говоря эта последовательность является арифметической, и значит $p_1 = \frac{1}{3}$ и $p_2 = \frac{2}{3}$.

Заметим, что если q_1 и q_2 вероятности чебурананья налево, то повторив те же вычисления получаем $q_1 = \frac{2}{3}$ и $q_2 = \frac{1}{3}$. Этого же можно добиться посмотрев на задачу через зеркало, оно меняет местами право и лево.

В частности из положения 1, робот чебурахается направо и налево с вероятностями $\frac{1}{3}$ и $\frac{2}{3}$, а вероятность того что он не чебуранется равна нулю $0 = 1 - \frac{1}{3} - \frac{2}{3}$. \square

Аналогично решается и вторая задача.

Решение второй задачи. Обозначим через s_1 и s_2 среднее число шагов которые сделает робот чтобы чебуранутся если начинает с первой или второй позиции соответственно. Из зеркальной симметрии (она меняет местами право и лево) следует, что $s_1 = s_2$, но мы и так это увидим скоро.

Заметим, что

$$s_1 = \frac{1}{2} \cdot 1 + \frac{1}{2} \cdot (1 + s_2).$$

Действительно, после первого шага с первой клетки с вероятностью $\frac{1}{2}$ робот чебурахнется налево то есть он проделает всего один шаг отсюда слагаемое $\frac{1}{2} \cdot 1$, и с той же вероятностью он перейдёт на второе место, откуда в среднем он пройдёт ещё s_2 шагов учтя первый шаг, получаем второе слагаемое $\frac{1}{2} \cdot (1 + s_2)$.

Аналогично получаем равенство

$$s_2 = \frac{1}{2} \cdot (1 + s_1) + \frac{1}{2} \cdot 1.$$

Получаем систему из двух равенств с двумя неизвестными s_1 и s_2 . Решив эту систему из двух уравнений получаем $s_1 = s_2 = 2$. \square

Попробуйте решить следующую задачу тем же способом.

Задача. На рисунке вы видите план города в котором отмечен дом доктора Шнобеля и пивная.

НУЖНА КАРТИНКА

Выйдя из дома на прогулку доктор выбирает с равной вероятности одну из дорог и идёт до следующего перекрёстка ровно одну минуту. Дойдя до перекрёстка он опять выбирает с равной вероятности одну из дорог, возможно ту по которой он пришёл, и идёт до следующего перекрёстка.

Если на перекрёстке есть рюмочная, он выпивает 50 грамм водки и продолжает свой путь. Прогулка заканчивается как только он приходит к своему дому.

Какова средняя продолжительность прогулки доктора Шнобеля?

Сколько грамм водки выпивает доктор Шнобель в среднем за одну прогулку?

4 Решения прямым подсчётом

Две задачи, рассмотренные выше, допускают решения через прямой подсчёт вероятностей. Мы опишем их, используя те же обозначения, что и раньше.

Решения. Чтобы решить вторую задачу, заметим что робот чебурахаётся на n -ом шагу либо влево либо вправо с вероятностью $(\frac{1}{2})^n$. А значит среднее число шагов можно найти просуммировав ряда

$$s_1 = s_2 = \frac{1}{2} \cdot 1 + \left(\frac{1}{2}\right)^2 \cdot 2 + \left(\frac{1}{2}\right)^3 \cdot 3 + \dots$$

Чтобы суммировать такой ряд нужно небольшое умение, но его сумма равна 2 и не удивительно, что то же значение получено выше.

Далее заметим, что если мы начали с первой клетки, то робот может чебурануться направо только на чётных шагах и если мы со второй клетки, то только на нечётных. То есть

$$\begin{aligned} p_1 &= \left(\frac{1}{2}\right)^2 + \left(\frac{1}{2}\right)^4 + \left(\frac{1}{2}\right)^6 + \dots \\ p_2 &= \left(\frac{1}{2}\right)^1 + \left(\frac{1}{2}\right)^3 + \left(\frac{1}{2}\right)^5 + \dots \end{aligned}$$

Применив формулу для суммы геометрической прогрессии получаем те же результаты $p_1 = \frac{1}{3}$ и $p_2 = \frac{2}{3}$. \square

Как видите, этот способ оказался сложнее. Кроме того, он не допускает лёгкого обобщения на случай когда стол имеет больше чем две клетки. Как мы увидим ниже, в этом случае наше решение остаётся практически без изменений.

5 Робот Чебуратор на длинном столе

Представим теперь, что Чебуратор стоит на длинном столе, он чебурахнется налево ему надо сделать i шагов а чтобы чебурануться налево ему надо сделать $m - i$ шагов. И нас интересуют всё те же задачи.

- Какова вероятность того, что он чебурахнется с правого края стола, и какова — что с левого?
- Чему равно среднее число шагов которые сделает робот чтобы чебурануться?

Решение первой задачи. Пронумеруем возможные положения чебуратора от числами от 1 до $m - 1$, по числу шагов налево которое чебуратору нужно сделать чтобы чебурахнуться.

Нам будет удобно добавить ещё два положения под номерами 0 и m ; первое соответствует тому что робот чебурахнулся налево а второй соответствует тому что робот чебурахнулся направо (из этих позиций выхода нет).

Обозначим через p_i вероятность того, что Чебуратор чебурахнется направо, если начинает с позиции под номером i . Естественно мы имеем

$$p_0 = 0 \text{ и } p_m = 1.$$

Применим тот же метод что и раньше. Стоя на клетке номер i , с вероятностью $\frac{1}{2}$ Чебуратор перейдёт на клетку номер $i + 1$ в этом случае вероятность того, что он чебурахнется вправо будет p_{i+1} и с той же вероятностью $\frac{1}{2}$ он перейдёт на клетку номер $i - 1$ в этом случае вероятность того, что он чебурахнется вправо будет p_{i-1} . То есть

$$p_i = \frac{1}{2} \cdot p_{i-1} + \frac{1}{2} \cdot p_{i+1}.$$

Иначе говоря в последовательности из $m + 1$ числа

$$0 = p_0, p_1, p_2, \dots, p_{i+j} = 1$$

каждое число является средним арифметическим соседей. Отсюда получаем $p_i = \frac{i}{m}$. \square

Решение второй задачи. Давайте использовать ту же нумерацию позиций как и в решении первой задачи.

Обозначим через s_i среднее число шагов если мы начинаем с позиции под номером i . Естественно предположить, что $s_0 = s_m = 0$, ведь попав на одну из этих клеток робот уже чебурахнулся.

Попробуем как и раньше посчитать значение s_i новым способом. После одного шага с i -ой клетки, Чебуратор окажется на клетке $i - 1$ или $i + 1$ с равными вероятностями $\frac{1}{2}$. После чего ему останется в среднем пройти s_{i-1} и s_{i+1} шаг соответственно. Не забыв учесть уже пройденный шаг, получаем

$$s_i = \frac{1}{2} \cdot (s_{i-1} + 1) + \frac{1}{2} \cdot (s_{i+1} + 1).$$

или

$$(**) \quad s_i = 1 + \frac{1}{2} \cdot (s_{i-1} + s_{i+1}).$$

Мы получаем $m - 1$ уравнение с $(m - 1)$ -ой неизвестной s_1, s_2, \dots, s_{m-1} .

Если догадаться, что s_i зависит квадратично от i , то несложно найти само решение $s_i = i \cdot (m - i)$. \square

Для закрепления материала мы советуем решить следующую задачу.

Пьяница вышел из бара, расположенного в 10 кварталах от своего дома на той же улице, чтобы вернуться домой; чтобы сделать дорогу домой веселее, он разнообразит её на каждом перекрёстке следующим образом. Дойдя до перекрёстка, он подкидывает монетку — и, если она выпадает орлом, он продолжает путь в том же направлении; если же она выпадает решкой, он разворачивается и идёт в противоположном направлении. Если ему случается вернуться к бару, он всегда разворачивается в сторону дома; если же он дошёл до своего дома, он завершает свой путь.

Сколько кварталов в среднем он пройдёт на этом пути?

Чему равно среднее число возвращений к бару при этой прогулке?

(Правильные ответы: 100 и 10 соответственно.)

6 Бактерии в пробирке

В пробирке живут 10 бактерий 3 зелёных и 7 жёлтых. Каждую секунду происходит следующее с равной вероятностью, одна из бактерий погибает и тут же одна из оставшихся (взятая с равной вероятностью) делится на две своих точных копии. Таким образом в конце секунды в пробирке остаётся ровно 10 бактерий.

Какова вероятность того что через некоторое время все станут зелёными?

Предположим, что через несколько секунд число зелёных бактерий стало i . Тогда спустя секунду их число может стать $i - 1$, i или $i + 1$. При этом вероятности первого и последнего исхода равны. Действительно, исход $i - 1$ означает, что первая бактерия оказалась зелёной а вторая жёлтой, а в исходе $i + 1$, наоборот первая жёлтой а вторая зелёной. Про исход i можно думать как про пропускание хода.

Таким образом наша задача становится похожей на задачу про робота чебуратора, только теперь Чебуратор ходит направо и налево с равными положительными вероятностями и с оставшейся вероятностью пропускает ход. Соответственно ответ в задаче можно получить подставив $i = 3$ и $m = 10$ в задачу про Чебуратора на длинном столе. То есть — с вероятностью $\frac{3}{10}$ все станут зелёными и с вероятностью $\frac{7}{10}$ все станут жёлтыми.

Эту же задачу (а значит и первую задачу про чебуратора) можно решить без вычислений. Заметим, что через некоторое время все бактерии в пробирке будут потомками одной из этих десяти бактерий и у каждой на

это есть равные шансы. Поэтому в 3 из 10 случаев все станут зелёными и в 7 из 10 все станут жёлтыми.

Остаётся только обосновать утверждение, что через некоторое время все бактерии в пробирке будут потомками одной. Для начала заметим, что с положительной вероятностью это может случиться за первые 10 секунд. Обозначим эту вероятность p ; тогда $q = 1 - p < 1$ есть вероятность того что это не произойдёт спустя первые 10 секунд. Легко видеть, что вероятность того, что это не произойдёт за $10 \cdot n$ меньше чем q^n . Поскольку $q < 1$, значение q^n идёт к нулю при $n \rightarrow \infty$, отсюда результат.

7 Броуновское движение

Заметьте, что если Чебуратор стоит на середине стола — чтобы чебурахнуться ему необходимо сделать n шагов вправо и столько же влево. Как мы выяснили, среднее число шагов которое он делает для того чтобы чебурахнуться равно n^2 . Это наблюдение можно использовать в обратном направлении, повторить это испытание много раз и измерить среднее количество шагов до чебуранья; взяв корень из полученного числа мы получим размер стола измеренный в шагах Чебуратора. В частности, зная размер стола мы сможем измерить шаг Чебуратора.

Поведение Чебуратора на столе мало чем отличается от хаотического перемещение очень малых частиц вещества под действием ударов молекул. Это движение было открыл Роберт Броун в начале 19-го века, в начале 20-го века была предъявлена модель для этого движения. В частности удалось оценить среднее число молекул в единице объёма по параметрам Броуновского движения. При этом оказалось достаточным наблюдений с помощью обычного микроскопа. Так была поставлена последняя точка в утверждении атомарной теории.

Эта физическая задача сложнее определения длины шага Чебуратора описанная нами чуть выше. Тем не менее между принципиальная идея решения у этих задач одна и та же.

8 Да, а о чём мы говорили?

Мы рассмотрели частный случай цепи Маркова. Чего советуем почитать...