

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
имени М. В. ЛОМОНОСОВА»

МЕХАНИКО-МАТЕМАТИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ

КАФЕДРА МАТЕМАТИЧЕСКОЙ ЛОГИКИ И ТЕОРИИ АЛГОРИТМОВ

ВЫПУСКНАЯ КВАЛИФИКАЦИОННАЯ РАБОТА
(ДИПЛОМНАЯ РАБОТА)
магистра

ПРИМЕНЕНИЕ ПРИНЦИПА РИССАНАНА MDL ДЛЯ МАРКОВСКИХ ЦЕПЕЙ

Выполнила студентка
группы М2 ЦТиИИ
Ремизова Анна Петровна

подпись студента

Научный руководитель:
д. ф.-м. н. профессор
Верещагин Николай Константинович

подпись научного руководителя

Москва

2023

Содержание

1	Введение	3
2	Марковские цепи с 2 состояниями	3
2.1	Таблицы с двоичными значениями	4
2.2	Анализ диграмм	4
3	Марковские цепи с 4 состояниями	9
4	Заключение	10

1 Введение

Основные термины

Актуальность, научная и практическая значимость работы

Постановка задачи

Есть данные – последовательность 0 и 1, мы хотим подобрать марковскую цепь, для которой наибольшая вероятность получить заданную траекторию. Например, эта последовательность может описывать некоторый текст, набор чисел и так далее. По Риссанену [1], если мы хотим предсказать, что будет дальше, то должны сравнивать друг с другом гипотезы по их сложности, причём даём преимущество простым гипотезам. Выражения для Description length будет выглядеть следующим образом:

$$\mathcal{D}(\mathcal{M}, x) = C(\mathcal{M}) + \log_2 \frac{1}{P_{\mathcal{M}}(x)} \quad (1)$$

где \mathcal{M} – выбранная модель, $C(\mathcal{M})$ – сложность модели (complexity), $P_{\mathcal{M}}(x)$ – вероятность в модели \mathcal{M} получить реализацию x .

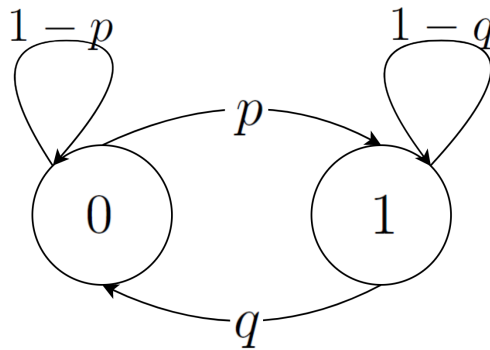
Цели и методы исследования

Обзор литературы

2 Марковские цепи с 2 состояниями

Для начала рассмотрим простые марковские цепи. Пусть марковская цепь состоит из 2 состояний (Рис. (1)). Дана последовательность состояний Марковской цепи из 2 состояний: 0 и 1. Найдём оптимальные переходные вероятности p из 0 в 1 и q из 1 в 0 по принципу Риссанена MDL. В данной задаче рассматриваются однородные цепи Маркова с конечным числом состояний, это означает, что переходные вероятности не зависят от номера шага, а зависят только от того состояния, в котором сейчас находится Марковская цепь.

Рис. 1: Марковская цепь с 2 состояниями



Для решения этой задачи запишем вероятность получения заданной реализации: пусть $n(ij)$ – число переходов из состояния i в состояние j , тогда вероятность получить реализацию x цепи \mathcal{M} :

$$P_{\mathcal{M}}(x) = p^{n(01)} \cdot (1-p)^{n(00)} \cdot q^{n(10)} \cdot (1-q)^{n(11)} \rightarrow \max \quad (2)$$

$$\mathcal{L}(\mathcal{M}, x) = \log_2 \frac{1}{P_{\mathcal{M}}(x)} = -(n(01) \cdot \log_2 p + n(00) \cdot \log_2 (1-p) + n(10) \cdot \log_2 q + n(11) \cdot \log_2 (1-q)) \quad (3)$$

Сложность $C(\mathcal{M})$ будем определять как суммарную длину дробной части записи p и q в двоичной системе счисления, так как $0 \leq p, q \leq 1$. Пусть вероятность p длины k , q – длины l , тогда $C(\mathcal{M}) = k + l$. Далее рассмотрим несколько реализаций Марковских цепей и исследуем, как меняются значения в зависимости от k и l .

2.1 Таблицы с двоичными значениями

В Таблицах (1, 2, 3) в каждой ячейке представлены сначала оптимальные (минимальные, т.к. ищем минимальную описательную длину) значения $\mathcal{L}(\mathcal{M}, x)$ (3), затем сложность по Риссанену, а после – значения p и q , при которых оно достигается, представленные в двоичной системе счисления, для марковских цепей с траекториями, соответствующими 30 первым знакам π , $\sqrt{2}$, $\sqrt{3}$ соответственно. По горизонтали отмечены значения l – длина перебираемых q в двоичной системе, по вертикали – значения k – длина перебираемых p в двоичной системе.

Выводы к Таблице (1) для π : заметим, что при фиксированной длине l (по столбцам) двоичной записи переходной вероятности q оптимальное значение q неизменно, но при этом с увеличением k оптимальное значение логарифма уменьшается. Аналогично для фиксированного k (по строкам).

Выводы к Таблице (2): для $\sqrt{2}$ практически то же, что и для π .

Выводы к Таблице (3): для $\sqrt{3}$ результаты уже отличаются от π , но наблюдаются те же закономерности. Отличие $\sqrt{3}$ от π и $\sqrt{2}$ в количестве диграмм в их двоичной записи, были рассмотрены первые 30 знаков для каждого числа, не считая точки. Если для π и $\sqrt{2}$ распределение количества диграмм близко к равномерному, то для $\sqrt{3}$ оно менее сбалансировано: количество диграмм 00 меньше остальных, а диграмм 11 – больше (см. Таблицу 4).

Утверждение 1 *Оптимальное значение p не зависит от q и наоборот, оптимальное значение q не зависит от p .*

Доказательство. Рассмотрим выражение (3) для логарифма. Значения $n(00), n(01), n(10), n(11)$ – постоянные, и данное выражения можно представить в виде линейной комбинации двух функций $f_1(p) + f_2(q)$. Соответственно, при максимизации всего выражения (логарифм (3) должен быть маленьким, а так как перед всем выражением стоит минус, то выражение в скобках должно быть большим), так как переменные p и q содержатся в отдельных слагаемых, необходимо найти минимум отдельно для $f_1(p)$ и $f_2(q)$, друг на друга их значения при минимизации не влияют. ■

2.2 Анализ диграмм

В Таблице (4) представлены количества диграмм по рассмотренным примерам – их сумма в каждом случае равна 29, так как рассматриваемые числа округлялись до 30 знаков в двоичной записи суммарно, далее оптимальные значения $k, l, \log_2 \frac{1}{P_{\mathcal{M}}(x)}, MDL$, найденные при $k, l \in [1, 6]$ для минимизации MDL .

Таблица 1: Таблица оптимальных зн-й р и q в двоичной записи для π

k / l	1	2	3	4	5	6
1	31.0	32.0	33.0	33.9891	34.9521	35.9521
	29.0	29.0	29.0	28.9891	28.9521	28.9521
	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
	0.1	0.10	0.100	0.1001	0.10001	0.100010
2	32.0	33.0	34.0	34.9891	35.9521	36.9521
	29.0	29.0	29.0	28.9891	28.9521	28.9521
	0.10	0.10	0.10	0.10	0.10	0.10
	0.1	0.10	0.100	0.1001	0.10001	0.100010
3	33.0	34.0	35.0	35.9891	36.9521	37.9521
	29.0	29.0	29.0	28.9891	28.9521	28.9521
	0.100	0.100	0.100	0.100	0.100	0.100
	0.1	0.10	0.100	0.1001	0.10001	0.100010
4	34.0	35.0	36.0	36.9891	37.9521	38.9521
	29.0	29.0	29.0	28.9891	28.9521	28.9521
	0.1000	0.1000	0.1000	0.1000	0.1000	0.1000
	0.1	0.10	0.100	0.1001	0.10001	0.100010
5	35.0	36.0	37.0	37.9891	38.9521	39.9521
	29.0	29.0	29.0	28.9891	28.9521	28.9521
	0.10000	0.10000	0.10000	0.10000	0.10000	0.10000
	0.1	0.10	0.100	0.1001	0.10001	0.100010
6	36.0	37.0	38.0	38.9891	39.9521	40.9521
	29.0	29.0	29.0	28.9891	28.9521	28.9521
	0.100000	0.100000	0.100000	0.100000	0.100000	0.100000
	0.1	0.10	0.100	0.1001	0.10001	0.100010

Утверждение 2 Значения $p = \frac{n(01)}{n(01) + n(00)}$ и $q = \frac{n(10)}{n(10) + n(11)}$ являются точкой максимума функции $\log_2 \frac{1}{P_M(x)}$ (3). Их значения при заданных длинах двоичной записи k и l - это приближения оптимальных значений p и q числами вида $x = \frac{n}{2^k}$ и $x = \frac{n}{2^l}$ соответственно.

Доказательство

1. Найдём точку максимума функции $f_1(p) = n(01) \log_2 p + n(00) \log_2 (1 - p)$. Её производная: $f'_1(p) = \frac{n(01)}{p \ln 2} - \frac{n(00)}{(1 - p) \ln 2}$, критические точки $p = \frac{n(01)}{n(01) + n(00)}$, $p = 0$, $p = 1$. Т.к. $0 \leq \frac{n(01)}{n(01) + n(00)} \leq 1$, то $f'_1(p)$ отрицательна на $p \in (-\infty; 0) \cup \left(\frac{n(01)}{n(01) + n(00)}; 1\right)$, положительная на остальных промежутках, а значит точка максимума $p = \frac{n(01)}{n(01) + n(00)}$, если это значение отлично от 0 и 1, и $p = 0$ иначе. Аналогично для $f_2(q)$ точкой максимума является $q = \frac{n(10)}{n(10) + n(11)}$, либо $q = 0$.

Таблица 2: Таблица оптимальных зн-й p и q в двоичной записи для $\sqrt{2}$

k / l	1	2	3	4	5	6
1	31.0	32.0	32.9148	33.7965	34.7965	35.795
	29.0	29.0	28.9148	28.7965	28.7965	28.795
	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
	0.1	0.10	0.101	0.1001	0.10010	0.100101
2	32.0	33.0	33.9148	34.7965	35.7965	36.795
	29.0	29.0	28.9148	28.7965	28.7965	28.795
	0.10	0.10	0.10	0.10	0.10	0.10
	0.1	0.10	0.101	0.1001	0.10010	0.100101
3	33.0	34.0	34.9148	35.7965	36.7965	37.795
	29.0	29.0	28.9148	28.7965	28.7965	28.795
	0.100	0.100	0.100	0.100	0.100	0.100
	0.1	0.10	0.101	0.1001	0.10010	0.100101
4	33.9891	34.9891	35.9039	36.7856	37.7856	38.7842
	28.9891	28.9891	28.9039	28.7856	28.7856	28.7842
	0.0111	0.0111	0.0111	0.0111	0.0111	0.0111
	0.1	0.10	0.101	0.1001	0.10010	0.100101
5	34.9521	35.9521	36.8669	37.7485	38.7485	39.7471
	28.9521	28.9521	28.8669	28.7485	28.7485	28.7471
	0.01111	0.01111	0.01111	0.01111	0.01111	0.01111
	0.1	0.10	0.101	0.1001	0.10010	0.100101
6	35.9521	36.9521	37.8669	38.7485	39.7485	40.7471
	28.9521	28.9521	28.8669	28.7485	28.7485	28.7471
	0.011110	0.011110	0.011110	0.011110	0.011110	0.011110
	0.1	0.10	0.101	0.1001	0.10010	0.100101

2. Рассмотрим функцию вероятности $P(x) = x^p(1-x)^{1-p}$. Найдём её вторую производную: $P'(x) = (1-x)^{-p}(p-x)x^{p-1}$, $P''(x) = (p-1)p(1-x)^{-p-1}x^{p-2}$. При фиксированном p $P''(x)$ имеет нули в точках $x = 0, x = 1$ и $P''(x) \geq 0$ на $x \in [0; 1]$, а значит на этом интервале исходная функция выпукла вверх – см. Рис. (2). Кроме того, её максимальное значение достигается при $x = p$. Так как при фиксированном k мы рассматриваем двоичные числа с k знаками после запятой, то $x = \frac{n}{2^k}, n \in \mathbb{N}$. Соответственно, оптимальным будет именно приближение точки максимума функции $P(x) : x = p$, а будет это приближение с избытком или недостатком – зависит от того, какое из чисел будет ближе к p по значению функции $P(x)$.

3. Для π оптимальные p и q , вычисленные по указанным формулам, выглядят следующим образом: $p_0 = 0.5_{10} = 0.1_2, q_0 = 0.5(3)_{10} = 0.(1000)_2$, чему удовлетворяют значения из Таблицы (1).

Для $\sqrt{2}$ имеем: $p_0 = 0.4(6)_{10} = 0.(0111)_2, q_0 = 0.(571428)_{10} = 0.(100)_2$ – по Таблице (2) совпадает q , но не совпадает, на первый взгляд, p . Но значение, представленное в таблице, к примеру, для $k = 6$ – это $0.011110_2 = \frac{30}{64_{10}}$, а значение, равное округ-

Таблица 3: Таблица оптимальных зн-й р и q в двоичной записи для $\sqrt{3}$

k / l	1	2	3	4	5	6
1	31.0	32.0	33.0	33.8419	34.8419	35.8419
	29.0	29.0	29.0	28.8419	28.8419	28.8419
	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
	0.1	0.10	0.100	0.0111	0.01110	0.011100
2	31.9053	32.9053	33.9053	34.7472	35.7472	36.7472
	28.9053	28.9053	28.9053	28.7472	28.7472	28.7472
	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11
	0.1	0.10	0.100	0.0111	0.01110	0.011100
3	32.4067	33.4067	34.4067	35.2486	36.2486	37.2486
	28.4067	28.4067	28.4067	28.2486	28.2486	28.2486
	0.101	0.101	0.101	0.101	0.101	0.101
	0.1	0.10	0.100	0.0111	0.01110	0.011100
4	33.4067	34.4067	35.4067	36.2486	37.2486	38.2486
	28.4067	28.4067	28.4067	28.2486	28.2486	28.2486
	0.1010	0.1010	0.1010	0.1010	0.1010	0.1010
	0.1	0.10	0.100	0.0111	0.01110	0.011100
5	34.4067	35.4067	36.4067	37.2486	38.2486	39.2486
	28.4067	28.4067	28.4067	28.2486	28.2486	28.2486
	0.10100	0.10100	0.10100	0.10100	0.10100	0.10100
	0.1	0.10	0.100	0.0111	0.01110	0.011100
6	35.4029	36.4029	37.4029	38.2448	39.2448	40.2448
	28.4029	28.4029	28.4029	28.2448	28.2448	28.2448
	0.101001	0.101001	0.101001	0.101001	0.101001	0.101001
	0.1	0.10	0.100	0.0111	0.01110	0.011100

Таблица 4: Числа, количество диграмм в них, оптимальные k и l

Число	$n(00)$	$n(01)$	$n(10)$	$n(11)$	k	l	$\log_2 \frac{1}{P_{\mathcal{M}(x)}}$	MDL
π	7	7	8	7	1	1	29.0	31.0
$\sqrt{2}$	8	7	8	6	1	1	29.0	31.0
$\sqrt{3}$	4	7	8	10	1	1	29.0	31.0

лению до 6 знаков после запятой найденного по формуле p – это $0.011101_2 = \frac{29}{64}_{10}$.
И действительно, если обозначить p_0 - найденное по формуле, то $\frac{29}{64} < p_0 < \frac{30}{64}$ и
 $0.00019 \approx \left| f_1(p_0) - f_1\left(\frac{30}{64}\right) \right| < \left| f_1(p_0) - f_1\left(\frac{29}{64}\right) \right| \approx 0.00800$.

Для $\sqrt{3}$ имеем: $p_0 = 0.(63)_{10} = 0.(1010001011)_2$, $q_0 = 0.(4)_{10} = 0.(011100)_2$ – по Таблице (3)

также совпадает q , и также совпадает p с верхним приближением: для $k = 6$, к примеру, $0.101001_2 = \frac{41}{64_{10}}$, $0.101000_2 = \frac{40}{64_{10}}$, $\frac{40}{64} < p_0 < \frac{41}{64}$.

Таким образом, на представленных примерах всё согласуется с утверждением. ■

Заметим по Таблице (4), что для рассмотренных трёх случаев высокая точность переходных вероятностей p и q не выгодна по Риссанену, Minimal description length достигается при $k = l = 1$. Это будет не так, если при увеличении на 1 бит точности переходной вероятности логарифм будет уменьшаться больше, чем на 1. Т.е. количество диграмм $n(00)$ и $n(01)$ должно быть сильно не сбалансированно.

Рассмотрим различные значения $n(01)$ для $n(00) = 1$ и найдём, при каком k достигается MDL. Алгоритм: берём $p = \frac{n(01)}{n(01) + n(00)}$, переводим в двоичную систему с k знаками после запятой, считаем для каждого $Descriptionlength = k - (n(01) \log_2 p + n(00) \log_2 (1 - p))$ и ищем минимальное такое при различных $k \in [1, 100]$ В Таблицах (5) видно, что результаты k уже нетривиальные – мы нашли те примеры последовательностей, для которых оптимальная модель подразумевает достаточно точные значения переходных вероятностей. Симметричная ситуация будет наблюдаться и для l .

Таблица 5: Оптимальные k для разных $n(01)$ – отличие от $n(00)$ в 2^x раз

$n(00)$	$n(01)$	k	p двоичная	p десятичная	$\log_2 \frac{1}{P_{\mathcal{M}}(x)}$	MDL
1	4	2	0.11	0.8	3.6601	5.6601
1	8	2	0.11	0.8889	5.3203	7.3203
1	16	3	0.111	0.9412	6.0823	9.0823
1	32	4	0.1111	0.9697	6.9795	10.9795
1	64	5	0.11111	0.9846	7.9314	12.9314
1	128	6	0.111111	0.9922	8.9082	14.9082
1	256	7	0.1111111	0.9961	9.8967	16.8967
1	512	8	0.11111111	0.9981	10.891	18.891
1	1024	9	0.111111111	0.999	11.8882	20.8882

Заметим, что для всех кодов в общем случае верно соотношение $\sum_b n(ab) = \sum_b n(ba)$ для всех букв a , кроме первой и последней (для них левая и правая части могут отличаться на 1) [2, стр. 147]. Тогда над двоичным алфавитом условие будет выглядеть несколько проще, т.е. будет выполнено одно из соотношений:

- а) $n(10) = n(01)$, если код начинается и заканчивается одной и той же буквой;
- б) $n(10) = n(01) - 1$, если код начинается с 0, а заканчивается 1;
- в) $n(10) = n(01) + 1$, если код начинается с 1, а заканчивается 0.

При этом $n(00), n(11)$ произвольны.

Так как в рассмотренных выше примерах кодами, реализациями Марковской цепи являлись первые 30 знаков двоичного представления чисел: $\pi \approx 11.0010010000111111011010101000_2$, $\sqrt{2} \approx 1.01101010000010011110011001100_2$, $\sqrt{3} \approx 1.1011101101100111101011101000_2$ – все они начинаются с 1, а заканчиваются 0, то для них как раз выполнено соотношение (в) (Табл. (4)).

Таблица 6: Оптимальные k для разных $n(01)$ – отличие от $n(00)$ в x раз

$n(00)$	$n(01)$	k	р двоичная	р десятичная	$\log_2 \frac{1}{P_{\mathcal{M}}(x)}$	MDL
100000	200000	9	0.101010101	0.6667	275489.1627	275498.1627
100000	300000	2	0.11	0.75	324511.2498	324513.2498
100000	400000	8	0.11001101	0.8	360965.426	360973.426
100000	500000	9	0.110101011	0.8333	390014.7766	390023.7766
100000	600000	9	0.110110111	0.8571	414171.2664	414180.2664
100000	700000	3	0.111	0.875	434851.5546	434854.5546
100000	800000	9	0.111000111	0.8889	452932.8105	452941.8105
100000	900000	9	0.111001101	0.9	468996.8194	469005.8194
100000	1000000	10	0.1110100011	0.9091	483446.7613	483456.7613

Соответственно, при задании реализации Марковской цепи с помощью количеств диграмм каждого вида мы вправе задать 3 свободные переменные $n(00), n(01), n(11)$, а $n(10)$ задать одним из 3 перечисленных выше способов. Для простоты будем считать, что $n(10) = n(01)$, и построим график значений MDL в зависимости от $k + l$ при $n(00) = n(11) = 1$.

Выводы

3 Марковские цепи с 4 состояниями

Рассмотрим более сложную марковскую цепь с четырьмя состояниями, но по-прежнему над двоичным алфавитом. Пусть в цепи четыре состояния a, b, c, d , при посещении части их них печатается 1, при посещении остальных – 0. Для некоторых последовательностей, в частности для тех, которые имеют период 4, например $x = 00010001 \dots 0001$, такая модель будет давать более оптимальный с точки зрения MDL результат: возьмём Марковскую цепь \mathcal{M} с состояниями $a = b = c = 0, d = 1$, (Рис. (3)) тогда при переходных вероятностях $p(a, b) = p(b, c) = p(c, d) = p(d, a) = 1$, остальных $p(i, j) = 0$ получаем $P_{\mathcal{M}}(x) = 1, \log_2 \frac{1}{P_{\mathcal{M}}(x)} = 0$, а значит сложность $\mathcal{D}(\mathcal{M}, x) = C(\mathcal{M}) = 16$ – столько бит нужно для хранения информации и всех 16 переходных вероятностях за 1 шаг (это 0 и 1 – по 1 биту), и это, очевидно, MDL для данной реализации цепи. Вообще говоря, для описания данной модели также нужно дополнительно 4 бит информации на описание чисел для каждого из 4 состояний, также 2 бит на начальное состояние (номер состояния – число от 0 до 4), но этот размер памяти одинаков для всех моделей из 4 состояний, поэтому при сравнении моделей его можно не учитывать.

Рассмотрим обратную задачу: зададим Марковскую цепь, случайным блужданием по ней получим некоторую реализацию и для неё найдём с помощью перебора оптимальную с точки зрения MDL модель. Сравним полученную модель с исходной. В случае Марковской цепи с 4 состояниями вероятность в модели \mathcal{M} получить реализацию x вычисляется по рекурсивной формуле:

$$P_a(x) = \begin{cases} \frac{1}{k} \sum_a P_b(x[1:]) & , \text{ а - первый символ} \\ \sum_b p(a, b) & , \text{ а - предпоследний символ} \\ \sum_b p(a, b) \cdot P_b(x[1:]) & , \text{ иначе} \end{cases} \quad (4)$$

где k – количество состояний Марковской цепи, выдающих первый символ строки, т.е. начальное состояние выбираем равновероятно, b – состояние Марковской цепи, выдающее символ, следующий за символом, выдаваемым состоянием a , $p(a, b)$ – переходная вероятность из состояния a в состояние b , $x[1:]$ – строка x без первого символа.

Рассмотрим произвольную нетривиальную матрицу P переходных вероятностей для 4 состояний (Табл. (7)), в ней элемент p_{ij} – вероятность перехода из состояния i в состояние j . Такая матрица обладает следующим свойством: сумма элементов по строкам равна 1. Пусть в состояниях a и b печатается 0, в состояниях c и d – 1. Обозначим такую модель за \mathcal{M} .

Таблица 7: Матрица переходных вероятностей для 4 состояний

	a	b	c	d
a	1/4	1/4	1/2	0
b	1/2	1/4	0	1/4
c	1/4	1/2	0	1/4
d	1/4	0	1/4	1/2

Пусть $k = 20$ – количество диграмм в слове, случайным блужданием по представленной Марковской цепи была получена реализация $x = 011110100010000111110$ длины $k + 1$, вероятность получить её в модели \mathcal{M} : $P(x) \approx 1.97 \cdot 10^{-6}$.

Переберём модели класса: в состояниях a и b печатается 0, в состояниях c и d – 1, с разными матрицами переходных вероятностей. Пусть вероятности – числа от 0 до 1 включительно с шагом 0.1, в каждой из 4 строк мы задаём 3 переходных вероятности, четвёртую вычисляем из соображения о том, что в сумме по строке 4 вероятности дают 1. Таким образом, в матрице переходных вероятностей P у нас 12 свободных переменных.

Выводы

4 Заключение

Список литературы

- [1] Rissanen J. MDL denoising //IEEE Transactions on Information Theory. – 2000. – Т. 46. – №. 7. – С. 2537-2543.
- [2] Верещагин Н., Щепин Е. Информация, кодирование и предсказание. – М.: МЦНМО, 2012

Рис. 2: График функции $P(x)$ при различных значениях p

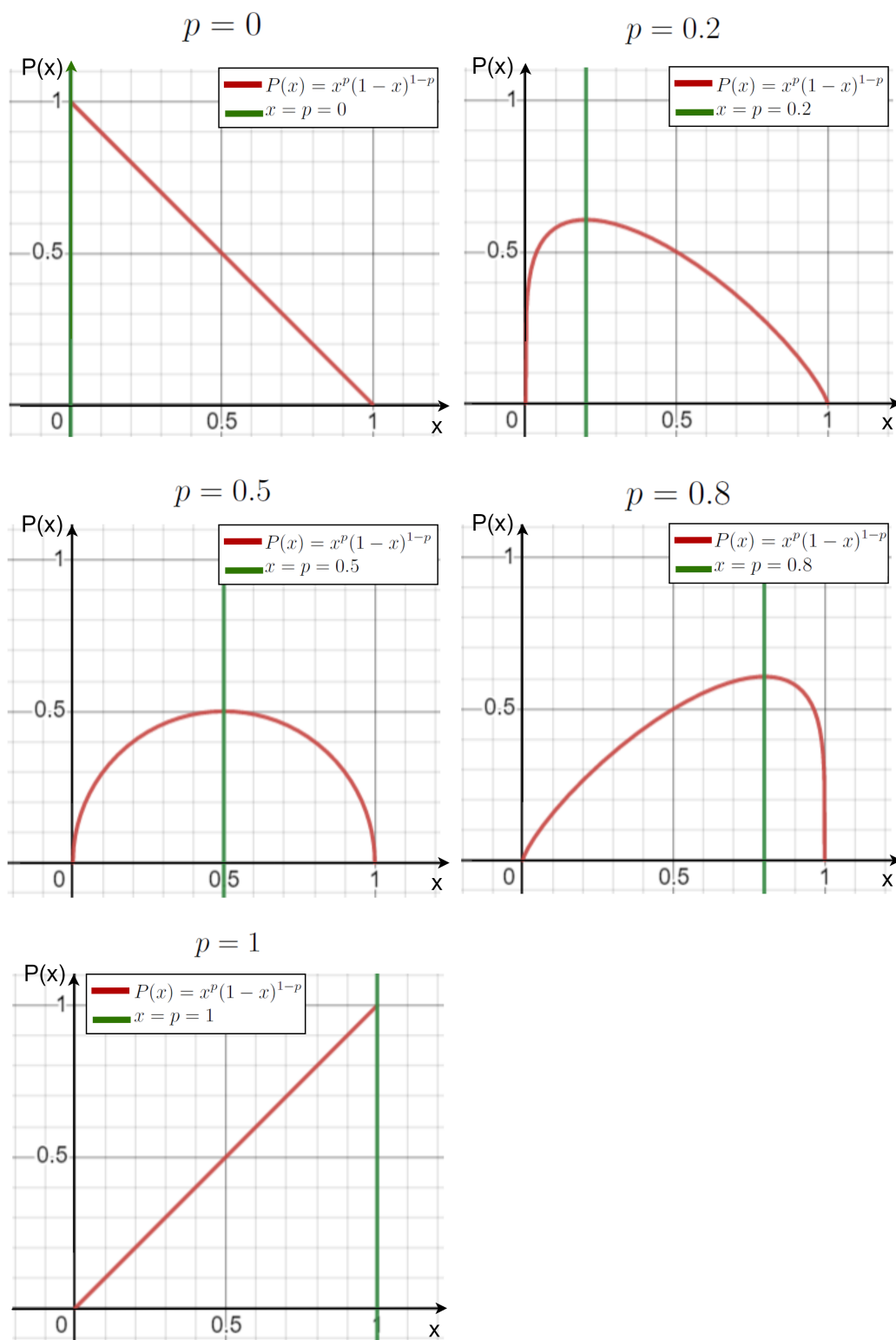


Рис. 3: Оптимальная Марковская цепь с 4 состояниями для последовательности 0001...0001

