

Содержание

1	Забери камень	1
2	Дерево игры	2
3	Определение высоты здания	3
4	Подбрасывание кубики	3
5	ООР и РОО	3
6	ООР и РОО с правом выбора	3
7	Ним-стоимость	3
8	Ним-подобные игры	3
9	Задача о разборчивой невесте	3
10	Труэль	4
11	Задача о делении ставки	4
12	Сходитесь!	4
13	Биномиальная модель цены акции	4
14	Опционы американского типа	4
15	Идеи	4
16	Решения	5

Цель

1. Забери камень

- 1.1 Четыреста лет назад, в 1612 г. в Лионе появилась книга поэта и математика Баше де Мезирьяка (Claude Gaspar Bachet de Méziriac ¹) «Занимательные и приятные числовые задачи» (Problèmes plaisants et délectables qui se font par les nombres). В ней была предложена следующая игра. Двое по очереди называют числа от 1 до 10, выигрывает тот, кто первым доведет сумму до 100. В чью пользу эта игра?

Ссылка на переиздание 1884 года <http://cnum.cnam.fr/DET/8PY45.html>, задача 22.

- 1.2 Цзяньшинцзы «Выбирание камней»

¹Баше де Мезирьяк перевел с греческого на латынь Арифметику Диофаната, на полях которой Ферма сформулировал свою великую теорему

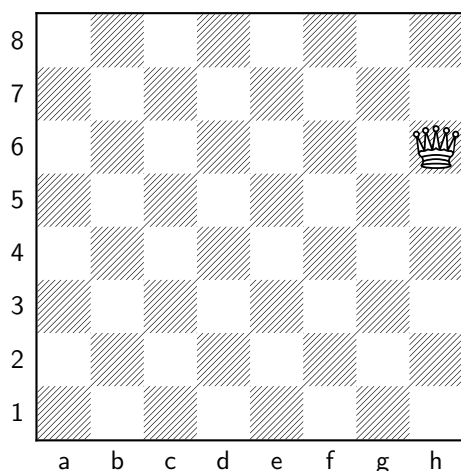
Древний Китай. Две кучки камней. Два игрока ходят по очереди. За один ход можно забрать либо произвольное число камней из одной кучки, либо одинаковое число камней из обеих. В одной кучке 5, а в другой — 8 камней.

Кто выигрывает при правильной игре?

1.3 «Одинокий ферзь»

Шахматная доска, одинокий раненый ферзь стоит на h6. Раненый ферзь как и ферзь может двигаться на любое число клеток, но только влево или вниз, или влево-вниз. Двое игроков ходят по очереди, тот кто переставит ферзя на a1 выиграл.

1. В чью пользу эта игра? Если в пользу первого, то с какого хода следует начать игру?
2. Найдите 10 отличий игры «Одинокий ферзь» от игры «Цзяньшинцзы»



1.4 «Набери чет»

В кучке 135 камней, двое по очереди забирают себе от 1 до 4 камней. Выигрывает тот, кто к концу игры наберет четное число камней.

Кто выигрывает при правильной игре?

2. Дерево игры

2.1 Кортес

Кортес с бандой головорезов высадился на берегу. Кортес выбирает, нападать ли на деревушку или нет.

Местная деревушка может либо сразу перейти в подчинение Кортеса, либо принять бой. Если деревушка примет бой, то выбор появится у Кортеса: либо драться до победного конца, либо после первых потерь бежать на кораблях обратно.

Ценность деревушки для Кортеса — одна единица, ценность собственных головорезов — 2 единицы. Если Кортес будет драться до конца, то деревушка будет взята, но большинство головорезов погибнет в бою. Для жителей деревушки — главное остаться в живых, сохранить при этом независимость, конечно, желательно.

1. Нарисуй дерево игры и найди обратно-индукционный исход.
2. Нарисуйте дерево игры и найдите обратно-индукционный исход в случае, если Кортес сжёт корабли.

2.2 Рулетки

Есть три рулетки: на первой равновероятно выпадают числа 2, 4 и 9; на второй — 1, 6 и 8; на третьей — 3, 5 и 7. Сначала первый игрок выбирает рулетку себе, затем второй игрок выбирает рулетку себе из двух оставшихся. После этого рулетки, выбранные игроками, запускаются, и случай определяет победителя. Победителем считается тот, чья рулетка покажет большее число.

Победитель получает от проигравшего 100 рублей.

В чью пользу эта игра?

3. Определение высоты здания

4. Подбрасывание кубики

5. ООР и РОО

6. ООР и РОО с правом выбора

7. Ним-стоимость

8. Ним-подобные игры

9. Задача о разборчивой невесте

9.1 Задача о Разборчивой Невесте, Secretary problem

К Разборчивой невесте выстроилась длинная-длинная вереница из потенциальных женихов.² Разборчивая невеста хочет выбрать самого богатого из них и только его! Потенциальные женихи заходят к Разборчивой невесте по одному в случайном порядке. Невеста неплохо разбирается в богатстве и всегда может ранжировать всех, с кем она общалась, по величине богатства. Когда к Разборчивой невесте приходит очередной претендент, она должна сразу принять решение: выбрать данного кандидата или перейти к следующему. Вернуться к предыдущим кандидатам невозможно — они обижаются и уезжают.

1. Как выглядит оптимальная стратегия Разборчивой невесты? Чему равна вероятность выбора самого богатого жениха Разборчивой невестой?
2. Подруга-дурнушка Разборчивой невесты хочет выбрать второго по богатству жениха и только его! Как выглядит её оптимальная стратегия? Чему равна вероятность выбора второго по богатству жениха Подругой-дурнушкой?

²Докторская диссертация член-корреспондента РАН Бориса Березовского «Разработка теоретических основ алгоритмизации принятия предпроектных решений и их применения» является обобщением задачи о разборчивой невесте, http://en.wikipedia.org/wiki/Secretary_problem

10. Труэль

10.1 Труэль

Три игрока решили стреляться ради самой красивой девушки и организуют труэль (дуэль для трёх игроков). Игроки стреляют по очереди, $A-B-C-A-...$ Каждый из игроков может либо целиться в одного из противников, либо стрелять в воздух. Вероятности попадания равны $p_a = 0.6$, $p_b = 0.5$ и $p_c = 0.4$, соответственно. Игра продолжается до определения единственного победителя, он и получает девушку в жёны.

1. Как выглядит оптимальная стратегия каждого игрока?
2. Чему равны вероятности выиграть для каждого игрока?

11. Задача о делении ставки

11.1 У домашнего учителя Алексея Ивановича один фридрихсдор. Перед ним обычная колода в 52 карты. Перед открытием каждой карты Алексей Иванович выбирает, какую долю своего богатства, от нуля до единицы, поставить на цвет следующей карты. Карты бывают двух цветов: чёрные и красные. Например, у Алексея Ивановича есть такая стратегия: не ставить ничего вплоть до последней карты и затем поставить весь рубль на нужный цвет. Такая стратегия гарантированно удвоит его богатство.

Найдите стратегию, которая максимизирует гарантированный выигрыш Алексея Ивановича. Чему равен этот максимальный гарантированный выигрыш?

12. Сходитесь!

12.1 Примирение невозможно, и потому Андрей и Борис решаются на дуэль.

12.2 Истеричная певица

Начинающая певица дает концерты каждый день. Каждый ее концерт приносит продюсеру 0.75 тысяч евро. После каждого концерта певица может впасть в депрессию с вероятностью 0.5. Самостоятельно выйти из депрессии певица не может. В депрессии она не в состоянии проводить концерты. Помочь ей могут только цветы от продюсера. Если подарить цветы на сумму $0 \leq x \leq 1$ тысяч евро, то она выйдет из депрессии с вероятностью \sqrt{x} .

Какова оптимальная стратегия продюсера? Продюсер максимизирует текущую ожидаемую ценность певицы.

задача о змее горыныче?

13. Биномиальная модель цены акции

14. Опционы американского типа

15. Идеи

1. Начинай с хвоста

2. Сделай первый шаг
3. Цена позиции
4. $MR=MC$, сформулировать словами (!)

16. Решения

1.1.

1.2.

1.3.

1.4.

2.1.

2.2. Вероятность выигрыша для второго игрока — $5/9$.

9.1. Пусть:

n - количество потенциальных женихов,

t - номер шага, на котором находится невеста,

G_t - вероятность того, что t -ый жених лучше всех предыдущих,

F_t - вероятность того, что пропустив t женихов и дальше пользуясь оптимальной стратегией (предполагается, что невеста будет пользоваться предложенной стратегией с $t + 1$ шага), невеста выберет в мужа самого богатого.

Определим вероятность G_t . Очевидно, что $G_n = 1$. Тогда вероятность того, что n -ый жених будет лучше всех предыдущих, равна $\frac{1}{n} \Rightarrow G_{n-1} = 1 - \frac{1}{n} = \frac{n-1}{n}$ - вероятность "победы" на $n - 1$ шаге. Пользуемся дальше подобной логикой. $\frac{1}{n-1}$ - вероятность того, что $n - 1$ жених лучше $n - 2 \Rightarrow$ вероятность того, что $n - 1$ будет не лучше $n - 2$ равна $1 - \frac{1}{n-1} = \frac{n-2}{n-1} \Rightarrow G_{n-2} = \frac{1}{n-1} \cdot 0 + \frac{n-2}{n-1} \cdot G_{n-1} = \frac{n-2}{n}$. Используя метод математической индукции получаем, что $G_t = \frac{t}{n}$.

Теперь найдём F_t . Для этого стоит уточнить, что Разборчивая невеста будет пользоваться оптимальной стратегией с $t + 1$ шага, то есть всех предыдущих женихов она сразу отвергает. И ещё очень важно заметить, что вероятность успеха невесты в её нелёгком деле не превышает величины $F_t \Rightarrow F_{t+1} \leq F_t \Rightarrow F_t$ - убывающая последовательность. Из всего вышесказанного делаем вывод, что $F_n = 0$, так как отвергнув последнего жениха, невеста останется одна $\Rightarrow F_{n-1} = \frac{1}{n}$ - вероятность, что n -ый жених лучше всех. Тогда $F_{n-2} = \frac{1}{n-1} \cdot \frac{n-1}{n} + \frac{n-2}{n-1} \cdot \frac{1}{n} = \frac{(n-2)+(n-1)}{n(n-1)}$. В данном случае сразу найти итоговый F_t затруднительно, поэтому рассмотрим величину $\frac{F_t}{G_t}$, тем более нам всё равно придётся сравнивать дальше эти величины. Получается, что $\frac{F_{n-2}}{G_{n-2}} = \frac{1}{n-1} + \frac{1}{n-2} \Rightarrow$ по методу математической индукции $F_t = \frac{t}{n} \cdot (\frac{1}{t} + \frac{1}{t+1} + \dots + \frac{1}{n-1})$.

Перейдём к самой стратегии. Представим, что F_t и G_t непрерывные функции (хотя это не так, потому что они зависят от целых чисел). Тогда F_t - монотонно убывающая функция, а G_t монотонно возрастающая и изобразить их в осях t, P , где P - вероятность и $E(G_t) = E(F_t) = [0; 1]$ (E - область значения), то найдётся такая точка T , в которой эти графики пересекутся \Rightarrow надо найти ближайшее целое t_1 ,

до которого невеста пропустит всех женихов, а дальше остановится на первом же, который лучше всех предыдущих.

Для того, чтобы найти это оптимальное t_1 , необходимо рассмотреть соотношение $\frac{F_t}{G_t}$ и сравнить его с 1. Получается, что $\frac{F_t}{G_t} = \frac{1}{t} + \frac{1}{t+1} + \dots + \frac{1}{n-1}$, для $t \geq t_1$.

Предположим, что n, t - достаточно большие числа, которые позволяют нам перейти к рассматриванию функций. Заметим, что если нарисовать график $y = \frac{1}{x}$, отметить точки $t, t+1, \dots, n$ и нарисовать прямоугольники с длиной соответствующей $\frac{1}{t}, \frac{1}{t+1}, \dots, \frac{1}{n}$ и шириной 1, то сумма площадей этих прямоугольников будет соответствовать $S = \frac{1}{t} + \frac{1}{t+1} + \dots + \frac{1}{n-1}$.

Если произвести сжатие и растяжение функции $y = \frac{1}{x}$ в t раз, величина $\frac{1}{t}$ станет очень маленькой \Rightarrow сумма площадей прямоугольников практически в точности будет соответствовать площади под графиком на отрезке $[t, n]$. Заметим, что равенство $S(xy) = S(x) + S(y)$ выполняется для всех $x, y > 1$, что соответствует одному из свойств логарифмов $\Rightarrow S(x) = \log_a(x) \Rightarrow$ для обратной функции будет выполняться $H(x+y) = H(x) * H(y) \Rightarrow$ это показательная функция $H(x) = a^x$. В итоге получаем, что a - это то самое число, которое нам надо узнать для того, чтобы найти $S(x)$. Так как $H(1) = a \Rightarrow F(a) = 1 \Rightarrow$ рассмотрим различные значения площади под $y = \frac{1}{x}$. $S(2) < 1 \Rightarrow a > 2$, $S(2,5) < 1 \Rightarrow a > 2,5$, $S(3) > 1 \Rightarrow a < 3 \Rightarrow$ интуитивно понятно, что $a = e$. В итоге имеем, что $\frac{F_t}{G_t} = 1 \Leftrightarrow \frac{n}{t} = e \Leftrightarrow \frac{t}{n} = \frac{1}{e} \Rightarrow F_t = G_t = \frac{t}{n} = \frac{1}{e} \Rightarrow$ вероятность «успеха» невесты найти самого богатого $\frac{1}{e} \approx 0,368$.

А оптимальная стратегия такова: пропустить $\approx 36,8\%$ женихов и выбрать первого же, который будет лучше всех своих предшественников.

10.1. Оптимальные стратегии

Оптимальная стратегия игрока А (вероятность попадания 0.6) - в любом случае будет стрелять в противника, так как его вероятность попасть больше, чем у остальных, а вероятность, что попадут в него, меньше.

Оптимальная стратегия игрока С (вероятность попадания 0.4) - стрелять в воздух до того момента, как в игре останутся два игрока (С + А/В). Так он дает сильным игрокам возможность "разобраться" друг с другом, и если один убивает другого, то следующим ходом он первым имеет возможность уничтожить оставшегося (пусть и с небольшой вероятностью). В противном случае, если он убивает А, то следующим ходом с большой вероятностью В убьет его самого.

Оптимальная стратегия игрока В (вероятность попадания 0.5) совпадает со стратегией игрока А (может быть, В и выгодно бы было отклоняться, но он понимает стратегию С и в таком случае не будет стрелять в воздух).

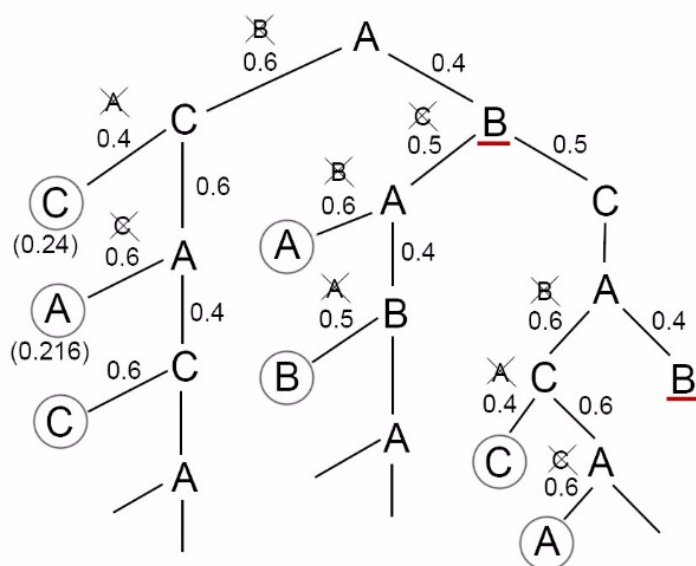
Решение по дереву вероятностей

1. Если первым выстрелом А убил В (с вероятностью 0.6), то шанс победить остается у А и у С. Вероятность, что дальше С попадет в цель своим первым выстрелом и победит = 0.24. Если же С промахивается, а следующим ходом А его убивает, то А побеждает с вероятностью 0.216. Если А промахивается, то исход дуэли решает С и цикл повторяется. Можно заметить, что вероятность победы любого из них - сумма бесконечно убывающей геометрической прогрессии.

$$\P(\text{победа С}) = \frac{0.24}{1-0.24} = 0.32$$

$$\P(\text{победа А}) = \frac{0.216}{1-0.24} = 0.28$$

2. Если первым выстрелом А не убивает В, то
 - а) следующим ходом В убивает С и победа разыгрывается между А и В;
 - б) В не убивает С, тогда (С стреляет в воздух) либо А убивает В, либо промахивается, и ход опять падает на В (при этом все живы) - цикл повторяется.



$$a) \mathbb{P}(\text{победа A}) = \frac{0.12}{1-0.2} = 0.15$$

$$\mathbb{P}(\text{победа B}) = \frac{0.04}{1-0.2} = 0.05$$

б) Теперь можно учесть повтор цикла для вероятности A и B (случай, когда A промахнулся и ход опять перешел B)

$$\mathbb{P}(\text{победа A}) = \frac{0.15}{1-0.2} = 0.19$$

$$\mathbb{P}(\text{победа B}) = \frac{0.05}{1-0.2} = 0.06$$

Если же A сразу убивает B, то (учитывая все циклы)

$$\mathbb{P}(\text{победа A}) = \frac{\frac{0.0432}{1-0.24}}{1-0.2} = 0.07$$

$$\mathbb{P}(\text{победа C}) = \frac{\frac{0.048}{1-0.24}}{1-0.2} = 0.08$$

Проверим сумму вероятностей: $0.32 + 0.28 + 0.19 + 0.06 + 0.07 + 0.08 = 1$

Результат:

$$\mathbb{P}(\text{победит A}) = 0.28 + 0.19 + 0.07 = 0.54$$

$$\mathbb{P}(\text{победит B}) = 0.06$$

$$\mathbb{P}(\text{победит C}) = 0.32 + 0.08 = 0.4$$

11.1.

12.1.

12.2. Рассмотрим совершенно конкурентный невольничий рынок начинающих певцов. Певцы в хорошем настроении продаются по V_1 , в депрессии — по V_2 . Получаем систему уравнений:

$$\begin{cases} V_1 = 0.75 + (0.5V_1 + 0.5V_2) \\ V_2 = \max_x \sqrt{x}V_1 + (1 - \sqrt{x})V_2 - x \end{cases}$$

Оптимизируем и получаем, $x^* = (V_1 - V_2)^2/4$. Из первого уравнения находим $(V_1 - V_2)/2 = 0.75$.