

随机算法

北京大学计算机系 蒋婷婷 2021年2月1日



什么是随机算法?

- 算法中加入随机性
 - 民意调查需要随机选择访问对象
- 对于很多问题,采用随机算法比采用确定型算法效率更高
- 随机算法的描述一般并不复杂,但是随机算法的分析比较复杂

概率论基础知识

- 随机变量X的加权平均值称为期望,记作E[X]
- 线性性质:

$$E[aX + bY] = aE[X] + bE[Y]$$

• 马尔科夫不等式

$$Pr[X \ge kE[X]] \le 1/k$$

• 在事件B发生的条件下,事件A发生的概率称为条件概率,记作Pr[A|B],计算公式为

$$Pr[A|B] = Pr[A \cap B] / Pr[B]$$

- 如果Pr[A|B] = Pr[A],则A和B是独立事件。
- 对于随机变量X和Y来说,如果所有可能的取值x和y,事件 $\{X = x\}$ 和 $\{Y = y\}$ 都是独立的,则称X和Y是独立随机变量



随机算法

Las Vegas 型随机算法

随机快速排序 随机选择 随机 n后放置

Monte Carlo型随机算法

主元素测试 串相等测试 模式匹配 素数测试

随机算法的分类与局限性



Las Vegas 型随机算法

随机快速排序 随机选择 随机 n后放置



随机快速排序算法

算法 随机快速排序算法

输入:包含n个元素的数组

输出: 经过排序的 n 个元素的数组

1. 若数组包含 0 或 1 个元素则返回

2. 从数组中随机选择一个元素作为枢轴元素

3. 把数组元素分为三个子数组,并且按照 A, B, C 顺序排列

A: 包含比枢轴元素小的元素;

B: 包含与枢轴元素相等的元素;

C: 包含比枢轴元素大的元素.

4. 对 A 和 C 递归地执行上述步骤.



算法分析

定理 设数组含n个不同元素,随机快速排序算法的期望比较 次数

$$T(n) \leq 2 n \ln n$$
.

证明一: 求解递推式

随机选取枢轴元素,其位于排序后第 i 位置 (i=0,1,...,n-1)的概率是1/n,A和C的元素数分别是i个和n-i-1个,得

$$T(n) = (n-1) + \frac{1}{n} \sum_{i=1}^{n-1} [T(i) + T(n-i-1)] = (n-1) + \frac{2}{n} \sum_{i=1}^{n-1} T(i)$$
解为 $\Theta(n\log n)$. 可归纳证明精确上界是 $T(n) \leq 2n \ln n$.

$$T(n) = (n-1) + \frac{2}{n} \sum_{i=1}^{n-1} 2i \ln i \le (n-1) + \frac{2}{n} \int_{1}^{n} 2x \ln x dx$$

$$\le (n-1) + \frac{2}{n} (n^{2} \ln n - \frac{n^{2}}{2} + \frac{1}{2}) \le 2n \ln n$$



随机选择算法

算法 RandSelect(A, p, r, k) //从A[p..r]中选第k小

- 1. if p=r then return A[p]
- 2. $i \leftarrow \text{Random}(p, r)$
- 3. 以 A[i] 为标准划分 A
- 4. j ←划分后小于等于 A[i] 的数构成数组的大小
- 5. if $k \le j$
- 6. then return RandSelect (A, p, p+j-1, k)
- 7. else return RandSelect (A, p+j, r, k-j)



时间期望值估计

假设1..n 中每个数被选的概率相等,并且假设第 k 个数总是出现在划分后两个数组中较大的数组,算法的期望时间为

$$T(n) \le \frac{1}{n} (T(n-1) + T(n-2) + \dots + T(\frac{n}{2} + 1) + T(\frac{n}{2} + 1) + T(\frac{n}{2}) + T(\frac{n}{2} + 1) + \dots + T(n-1) + O(n) \le \frac{2}{n} \sum_{i=n/2}^{n-1} T(i) + O(n)$$

归纳证明 $T(n) \leq cn$. 归纳步骤如下: 假设对 k < n 命题为真,

$$T(n) \le \frac{2}{n} \left[c \frac{n}{2} + c \left(\frac{n}{2} + 1 \right) + \dots + c(n-1) \right] + tn = \frac{2c}{n} \frac{\left(\frac{n}{2} + n - 1 \right) \frac{n}{2}}{2} + tn$$

$$= \frac{3cn}{4} - \frac{c}{2} + tn \le \frac{3cn}{4} + tn = \left(\frac{3}{4} + \frac{t}{c} \right) cn \le cn, \quad \text{iff } c \ge 4t \text{ [PF]}$$



n后放置的随机选择

算法BoolQueen(n)

```
// k 放皇后的行号
1. k←1
                          // count 放好的皇后数
2. count \leftarrow 0
3. while k \le n do
                             // i 为待选列号
     for i \leftarrow 1 to n do
        检查i与前面k-1个皇后的相容性
5.
        如果相容则将i加入S
6.
   if S\neq\emptyset then
7.
8.
        j \leftarrow \text{Random}(1, |S|)
9.
        x_k \leftarrow S[j]
10.
        count←count+1
11.
      k\leftarrow k+1
12. else k \leftarrow n+1
13. return count
```



n后问题的随机算法

算法QueenLV(n) //重复调用随机算法BoolQueen

- 1. $p \leftarrow BoolQueen(n)$
- 2. while p < n do
- 3. $p \leftarrow BoolQueen(n)$

改进算法---与回溯相结合

设 stop Vegas ≤ n,表示用QueenLV算法放置的皇后数

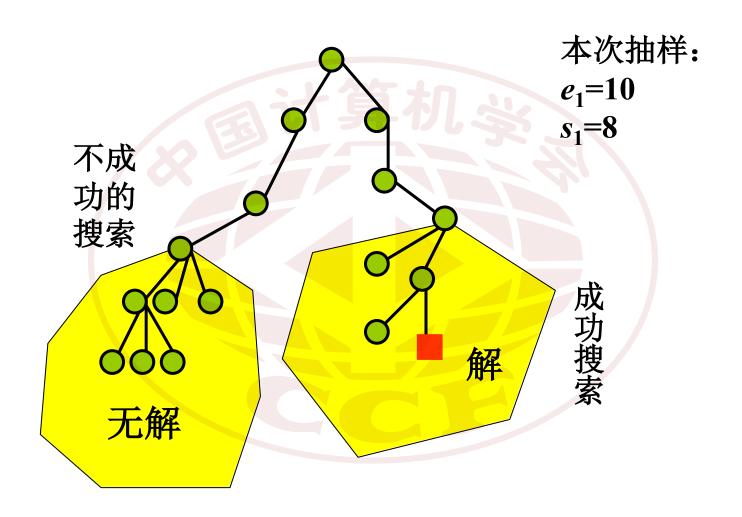
剩下 n - stop Vegas 个皇后用回溯方法放置

stop Vegas = 0 时是完全的回溯算法

stop Vegas = n 时是完全的Las Vegas算法



成功搜索与不成功搜索





改进算法的分析

对于不同的 stop Vegas 值,设

- p为算法成功概率
- s为一次成功搜索访问的结点数的平均值
- e为一次不成功搜索访问的结点数的平均值

$$t$$
 为算法找到一个解的平均时间
 $t = ps + (1-p)(e+t) \Rightarrow t = s + e \frac{1-p}{p}$

n=12时的统计数据: stopVegas = 5时算法效率高

stopVegas	p	S	e	t
0	1.0000	262.00	<u> </u>	262.00
5	0.5039	33.88	47.23	80.39
12	0.0465	13.00	10.20	222.11



LasVegas型随机算法总结

特点

通过修改确定性算法得到,一般将算法的某步的确定型选择变成随机选择

一次运行可能得不到解;若得到解,则解一定是正确的 改进途径:与确定型算法相结合 有可能改进确定型算法平均情况下的时间复杂度

• 有效的 Las Vegas 算法

运行时间是随机变量,期望运行时间是输入的多项式且总能给出正确答案的随机算法



Monte Carlo型随机算法

主元素测试 串相等测试 模式匹配 素数测试



主元素测试

问题

主元素: 出现次数超过一半以上的元素

输入: n 个元素的数组 T

输出:如果存在主元素则输出"true",否则"false"

算法 Majority(T,n)

- 1. $i \leftarrow \text{Random}(1,n)$
- 2. $x \leftarrow T(i)$
- 3. 计数x在T中出现的个数k
- 4. if k>n/2 then return true
- 5. else return false

算法的正确性

若回答true:则T存在主元素,算法正确;若回答false,T仍可能存在主元素,算法可能出错.回答正确概率大于1/2.

算法 BoolMajority(T,n)

- 1. if Majority(T,n) then return true
- 2. else return Majority(T,n)

BoolMajority 算法正确的概率为

$$p + (1-p)p = 2p - p^2 = 1 - (1-p)^2 > \frac{3}{4}$$

调用 k 次Majority算法正确的概率为

$$p + (1-p)p + (1-p)^2 p + ... + (1-p)^{k-1} p = 1 - (1-p)^k > 1 - 2^{-k}$$

调用次数 k	1	2	3	4	5	6
正确概率大于	0.5	0.75	0.875	0.938	0.969	0.985



改进途径

对于任意给定的 $\varepsilon>0$, 如果要使出错的概率不超过 ε ,则调用 次数 k 满足

$$\left(\frac{1}{2}\right)^{k} \le \varepsilon \Rightarrow k \log \frac{1}{2} \le \log \varepsilon \Rightarrow -k \le \log \varepsilon$$
$$\Rightarrow k \ge -\log \varepsilon \Rightarrow k \ge \left\lceil \log \frac{1}{\varepsilon} \right\rceil$$

出错概率不超过ε的算法——MCMajority

算法 MCMajority(T,n,ε)

- 1. $k \leftarrow \lceil \log(1/\epsilon) \rceil$
- 2. for $i \leftarrow 1$ to k
- 3. if Majority(T,n) then return true
- 4. return false



串相等测试

问题: A 有一个长串 x, B 有长串 y, A 和 B 希望知道 x=y?

方法一:

A将x发送给B, B测试x=y? 发送消耗:长串占用信道资源大

方法二:

A用x导出一个短串f(x) (fingerprints)

A将f(x)发送到B

B 使用同样方法导出相对于y 的短串 f(y)

B 比较 f(x) 与 f(y)

如果 $f(x) \neq f(y)$, 则 $x \neq y$;

如果 f(x) = f(y),则不确定.

指纹产生

设x和y的二进制表示为正整数I(x),I(y)

选择素数p,指纹函数为

$$I_p(x) = I(x) \mod p$$

A 传送 p 和 $I_p(x)$ 给 B. 当 p 不太大时,传送一个短串.

存在问题:

$$x = y \Rightarrow I_p(x) = I_p(y)$$

 $I_p(x) = I_p(y) \Rightarrow x = y$

出错条件: 固定

$$p \mid (I(x) - I(y))$$



改进算法的途径

改进方法: 随机选择素数 p 进行测试

算法 StringEqualityTest

- 1. 随机选择小于M的素数p //M为正整数
- 2. A 发送 p 和 $I_p(x)$ 给 B
- 3. B 测试是否 $I_p(x) = I_p(y)$

出错的必要条件:

x 的位数等于y 的位数

$$p \mid (I(x)-I(y))$$



有关素数的性质

函数 $\pi(t)$: 小于 t 的不同的素数个数,

例如, $\pi(20)=8$,素数8个: 2, 3, 5, 7, 11, 13, 17, 19

两个相关结果:

- (1) 素数定理 $\pi(t) \approx t/\ln t$
- (2) 若 $k < 2^n$, n 不太小,整除 k 的不同素数个数小于 $\pi(n)$

n	10 ³	104	10 ⁵	10^6	107
$\pi(n)$	168	1229	9592	78498	664579
<i>t/</i> ln <i>t</i>	145	1086	8686	72382	620421
比值	1.159	1.132	1.104	1.085	1.071

 $k < 2^{10} = 1024$,整除 k的素数个数 $< \pi(10) = 4$, 例如 k = 984,整除 984的素数只有 2, 3, 41



出错概率估计

n: x 和 y 的二进制表示的位数 $x, y \le 2^n$

若选择 $M \ge 2n^2$, 一次测试的出错概率估计:

$$\frac{|\{p \mid p$$
是小于 2^n 的素数,且 p 整除 $I(x) - I(y)\}|}{\pi(M)}$

$$\leq \frac{\pi(n)}{\pi(M)} \approx \frac{n/\ln n}{2n^2/\ln(2n^2)} \approx \frac{n/\ln n}{2n^2/2\ln n} \leq \frac{1}{n}$$



改进算法

重复执行j次,每次随机选择小于M的素数

算法 StringTest

输入: x, y, n位二进制数

输出: "Yes" (如果x = y); 或者 "No" (如果 $x \neq y$)

- 1. for $i\leftarrow 1$ to j
- 2. 随机选择小于M的素数p // M为正整数
- 3. A 发送p 和 $I_p(x)$ 给B
- 4. *B* 测试
- 5. if $I_p(x) \neq I_p(y)$
- 6. then return "No"
- 7. return "Yes"



算法分析

令 $j = \lceil \log \log n \rceil$,则算法出错的概率

$$\left(\frac{1}{n}\right)^{j} \le \frac{1}{n^{\lceil \log \log n \rceil}}$$

实例: x 和 y 是1000000位二进制数

$$n = 10^6$$

$$M = 2 \cdot 10^{12} = 2^{40.8631}$$

素数p的二进制表示至多 $\log M$ +1 = 41 位

$$I_p(x)$$
 的位数至多 $\lfloor \log(p-1) \rfloor + 1 \leq \lfloor \log M \rfloor + 1 = 41$

总共传送82位



模式匹配

问题: 输入二进制串 $X = x_1 x_2 ... x_n$, $Y = y_1 y_2 ... y_m$, $m \le n$

输出: 若Y在X中,Y出现的第一个位置; 否则为"0"

算法一: 顺序比较

初始 Y与 X 的首元素对齐,依次从前到后比较 X与 Y 的元素. 如果 X与 Y的所有元素都相等,输出 Y的首位置 j; 否则将 Y的位置向后移动一个字符,重复原来过程.

运行时间: O(mn)

算法二:利用有限状态自动机的模式匹配算法 (Knuth, Morris, Pratt), Introduction to Algorithms 运行时间: *O*(*m*+*n*)



随机算法

算法三 利用串比较的随机算法

设计思想:设 $X(j) = x_j x_{j+1} ... x_{j+m-1}$,把X(j) (j=1,2,...,n-m+1) 与Y逐个字符的比较,改成对指纹 $I_p(X(j))$ 与 $I_p(Y)$ 的比较

$$X(j)$$
与 $X(j+1)$ 的关系 $X(j) = 2^{m-1}x_j + 2^{m-2}x_{j+1} + \dots + 2x_{j+m-2} + x_{j+m-1}$

$$X(j+1) = 2^{m-1}x_{j+1} + 2^{m-2}x_{j+2} + \dots + 2x_{j+m-1} + x_{j+m}$$

$$X(j+1) = 2X(j) - 2^m x_j + x_{j+m}$$

x_j		χ_{j+m-1} χ_{j+m}	X(j)
	x_{j+1}	X_{j+m-1} X_{j+m}	$X(j\pm 1)$



算法三的关键技术

由 $I_p(X(j))$ 求 $I_p(X(j+1))$ 的公式

$$I_p(X(j+1)) = (2I_p(X(j)) - W_p x_j + x_{j+m}) \pmod{p}$$

 $W_p = 2^m \pmod{p}$

该公式说明: 由 $I_p(X(j))$ 计算 $I_p(X(j+1))$ 仅需要常数时间 公式的证明:



算法

算法 PatternMaching

输入: 串 X 和 Y, |X|=n, |Y|=m, $m \le n$

输出:如果 Y在 X中, Y出现的第一位置;否则为"0"

- 1. 从小于 M 的素数集合中随机选择素数 p
- 2. $j \leftarrow 1$
- 3. $W_p \leftarrow 2^m \pmod{p}$
- $4. \ I_p(X(j)) \leftarrow I(X(j)) \pmod{p}$
- 5. $I_p(Y) \leftarrow I(Y) \pmod{p}$
- 6. while $j \le n-m+1$ do
- 7. if $I_p(X(j)) = I_p(Y)$ then return j
- 8. $I_p(X(j+1)) \leftarrow (2I_p(X(j)) W_p x_j + x_{j+m}) \pmod{p}$
- 9. *j*←*j*+1
- 10. return 0



算法分析

时间复杂度为 O(m+n)

$$W_p, I_p(Y), I_p(X(1))$$
 计算 $O(m)$ 时间 从 $I_p(X(j))$ 计算 $I_p(X(j+1))$ 总共需要 $O(n)$ 时间

出错条件:

$$Y \neq X(j) \land I_{p}(Y) = I_{p}(X(j))$$

$$\Leftrightarrow p \mid \prod_{\{j \mid Y \neq X(j)\}} |I(Y) - I(X(j))|$$

出错概率:乘积大小不超过 $(2^m)^n$,整除它的素数个数不超过 $\pi(mn)$,选 $M=2mn^2$,则出错概率不超过

$$\frac{\pi(mn)}{\pi(M)} \approx \frac{mn/\ln(mn)}{2mn^2/\ln(mn^2)} = \frac{\ln(mn^2)}{2n\ln(mn)} < \frac{\ln(mn)^2}{2n\ln(mn)} = \frac{1}{n}$$



素数测试

- 求 x 的 m 次幂
- ·求a的模n的m次幂
- Fermart小定理
- 测试算法分析



输入: x为实数

$$m = d_k d_{k-1} ... d_1 d_0$$
 为二进制自然数

输出: x^m

算法 Exp(x,m)

- 1. $y \leftarrow 1$;
- 2. for $j \leftarrow k$ downto 0 do
- 3. $y \leftarrow y^2$
- 4. if $d_i=1$ then $y \leftarrow xy$
- 5. return y

实例

$$x^{101}$$
: $d_2=1, d_1=0, d_0=1$
 $y=1$

$$j=2$$
 $j=1$ $j=0$

$$j=2$$
 $j=1$ $j=0$
 $y=1$ $y=x^2$ $y=x^4$

$$y=x$$
 $y=x^5$



a模n的m次幂

输入: $a, m, n \in \mathbb{Z}^+$, $m \leq n$,

 $m = b_k b_{k-1} \dots b_1 b_0$ 为二进制自然数

输出: $a^m \pmod{n}$

算法ExpMod(a, m,n)

- 1. $c\leftarrow 1$
- 2. for $j \leftarrow k$ downto 0 do
- 3. $c \leftarrow c^2 \pmod{n}$
- 4. if $b_j=1$ then $c \leftarrow ac \pmod{n}$
- 5. return c

 $T(n)=O(k\log^2 n)=O(\log^3 n)$ 以位乘作为基本运算



Fermart小定理:测试原理

定理1: 如果 n为素数,则对所有的正整数 $a \neq 0 \pmod{n}$ 有 $a^{n-1} \equiv 1 \pmod{n}$

素数测试原理: 检测 $2^{n-1} \equiv 1 \pmod{n}$. 如是,输出"素数" 否则输出"合数"

算法 Ptest1(n)

输入: 奇整数 n, n > 5

输出: "prime"或者 "composite"

- 1. if ExpMod(2,n-1,n) = 1 then return prime
- 2. else return composite

问题: 算法 Ptest1只对a=2进行测试. 如果 n为合数且算法输出"素数",则称 n 为基2的伪素数. 例如341.



改进算法(一)

改进算法: 随机选取2--*n*-1中的数,进行测试. 如取a=3, 3^{340} (mod 341) = 56,341不是素数.

算法Ptest2(n)

- 1. $a \leftarrow \text{Random}(2, n-2)$
- 2. if Expmod(a, n-1, n)=1 then return prime
- 3. else return composite
- Fermat 小定理是必要条件,不是充分条件,满足该条件的也可能是合数. 对所有与 n 互素的正整数 a 都满足条件的合数 n 称为 Carmichael数,如 561,1105,1729,2465等. Carmichael数非常少,小于 10^8 的只有 255 个.
- 由初等数论可以证明:如果n为合数,但不是Carmichael数,算法Ptest2测试n为合数的概率至少为1/2.

素数的另一个必要条件

定理2 如果 n为素数,则方程 $x^2 \equiv 1 \pmod{n}$ 的根只有两个,即 x = 1, x = -1(或 x = n-1).

证明 $x^2 \pmod{n} \equiv 1$ $\Leftrightarrow x^2 - 1 \equiv 0 \pmod{n}$ $\Leftrightarrow (x+1)(x-1) \equiv 0 \pmod{n}$ $\Leftrightarrow x+1 \equiv 0$ 或 $x-1 \equiv 0$ (域中没有零因子) $\Leftrightarrow x = n-1$ 或 x=1称 $x \neq \pm 1$ 的根为非平凡的.

判别方法: 如果方程有非平凡的根,则 n 为合数.

结论:由于5和7是非平凡的根,12是合数



测试方法

设 n为奇素数,存在 q, m 使得 n–1=2 q m, (q≥1). 构造序列:

 $a^m \pmod{n}, a^{2m} \pmod{n}, a^{4m} \pmod{n}, \dots, a^{2^q m} \pmod{n}$ 其最后一项为 $a^{n-1} \pmod{n}$,而且每一项是前面一项的平方.

测试方法:

1. 对于任意 i (i = 0,1,...,q-1),判断 $a^{2^{i}m} \pmod{n}$

是否为 1 和 n-1, 且它的后一项是否为1.

- 2.如果其后项为1,但本项不等于 1 和 n-1,则它就是非平凡的根,从而知道 n不是素数.
- 3. 随机选择 $a \in \{2, 3, ..., n-1\}$, 进行上述测试.

实例

例如 n=561, $n-1=560=2^4$ · 35, 假设 a=7, 构造的序列为

$$7^{35} \pmod{561} = 241,$$
 $7^{2^{1}35} \pmod{561} = 7^{70} \pmod{561} = 298,$
 $7^{2^{2}35} \pmod{561} = 7^{140} \pmod{561} = 166,$
 $7^{2^{3}35} \pmod{561} = 7^{280} \pmod{561} = 67,$
 $7^{2^{4}35} \pmod{561} = 7^{560} \pmod{561} = 1$

第 5 项为 1, 但是第 4 项等于 67, 它既不等于 1 也不等于 560, 是个非平凡的根, 因此可以判定 *n* 为合数.

根据这个思想设计的计算机算法称为 Miller-Rabin 算法,它随机选择正整数 $a \in \{2,3,...,n-1\}$, 然后进行上述测试.



算法子过程(一)

算法 findq-m(n) //找 q, m 使得 n-1=2qm

- 1. $q \leftarrow 0$; $m \leftarrow n-1$
- 2. repeat
- $3. \quad m \leftarrow m/2$
- 4. $q \leftarrow q+1$
- 5. until m是奇数

运行时间: $O(\log n)$



算法子过程(二)

算法 test(n, q, m) //检测序列是否存在非平凡的根

- 1. $a \leftarrow \text{Random}(2, n-1)$
- 2. $x_0 \leftarrow \text{ExpMod}(a, m, n)$ $//x_0 = a^m \pmod{n}$, $O(\log^3 n)$
- 3. for $i \leftarrow 1$ to q do $//q = O(\log n)$
- 4. $x_i \leftarrow x_{i-1}^2 \pmod{n}$ // $O(\log^2 n)$
- 5. if $x_i = 1$ and $x_{i-1} \neq 1$ and $x_{i-1} \neq n-1$
- 6. then return composite
- 7. if $x_q \ne 1$ then return composite
- 8. return prime

性能分析:

- 1 次测试运行时间 $O(\log^3 n)$
- 可证明1次测试出错的概率至多 1/2.
- 重复运行 k 次,可将出错概率降到至多 2^{-k} .



Miller-Rabin算法

令 $k=\lceil \log n \rceil$,出错的概率小于等于 $2^{-k} \le 1/n$. 即算法给出正确答案的概率为1-1/n. 换句话说,如果n为素数,则算法输出素数. 如果n为合数,则算法以1-1/n的概率输出"合数".

算法 Premality Test(n) // n ≥ 5, 奇整数

- 1. findq-m(n)
- 2. $k \leftarrow \lceil \log n \rceil$
- 3. for $i \leftarrow 1$ to k

//重复执行 $\log n$ 次

4. test(n, q, m)

时间: $T(n) = O(\log^4 n)$ // 按位乘统计



Las Vegas型与 Monte Carlo型随机算法

• Las Vegas型随机算法

- 如果得到解,总是给出<mark>正确</mark>的结果,区别只在于运行时间 的长短.
- 拉斯维加斯型随机算法的运行时间本身是一个随机变量
- 期望运行时间是输入规模的多项式且总是给出正确答案的 随机算法称为有效的拉斯维加斯型算法.

Monte Carlo型随机算法

- 这种算法有时会给出错误的答案.
- 其运行时间和出错概率都是随机变量,通常需要分析算法的出错概率.
- 多项式时间内运行且出错概率不超过1/3的随机算法称为 有效的蒙特卡洛型算法



单侧错误和双侧错误

- 弃真型单侧错误
 - 当算法宣布接受时,结果一定是对的
 - 当算法宣布拒绝时,结果有可能是错的
 - 例如主元素测试算法
- 取伪型单侧错误
 - 当算法宣布拒绝时,结果一定是对的
 - 而当算法宣布接受时,结果有可能是错的
 - 例如素数测试
- 双侧错误
 - 在所有的输入上同时出现上述两种不同的错误



随机算法的分类与局限性

- 拉斯维加斯型随机算法
 - 零错误概率多项式时间算法(有效的), ZPP
- 蒙特卡洛型随机算法
 - 错误概率有界的有效算法(多项式时间), BPP
 - 弃真型单侧错误概率有界的有效算法,RP
 - 取伪型单侧错误概率有界的有效算法,coRP
- 随机算法的局限性
 - 错误概率有界的多项式时间随机算法不太可能解决NP 完全问题



总结

- 随机算法的两种类型
- 随机算法的分析方法