

Model Chandrasekhara / Smoluchowskiego - 1 pudełko

Piotr Piękos

25 lipca 2019

1 Oznaczenia

W celach notacyjnych rozbijemy proces $X(t)$ (ilość żyjących osób) na dwa procesy:

- $N(t)$ - Ilość narodzin
- $S(t)$ - Ilość śmierci

Wtedy $X(t) = N(t) - S(t)$, Dodatkowo oznaczymy intensywności procesów przez:

- a_N - intensywność procesu narodzin
- a_S - parametr rozkładu wykładniczego odpowiadającego za długość życia

Dodatkowe oznaczenia:

- $I_X(t)$ - indeksy "żywych" zmiennych w momencie t .
- W_i - zmienna losowa (o rozkładzie wykładniczym z parametrem a_S) mówiąca o długości życia osoby i

Możnaby spróbować zamodelować $S(t)$ jako niejednorodny proces Poissona z intensywnością zależną od $N(t)$. Ja jednak to rozdzieliłem jedynie ze względów notacyjnych.

2 Prawa ewolucji

$P(X(t+h) = x+1 | X(t) = 1)$:

Korzystamy tutaj z faktu, że dla procesu Poissona (N) mamy:

- $P(N(t+h) = n+1 | N(t) = n) = a_N h + o(h)$
- $P(N(t+h) \geq n+2 | N(t) = n) = o(h)$

Dodatkowo:

- $P(N(t+h) = n | N(t) = n) = 1 - a_N h + o(h)$
- $P(S(t+h) = s | S(t) = s, X(t) = x) = P(\forall_i \in I_X(t) W_i \geq h) + o(h) = \prod_{i \in I_X(t)} P(W_i \geq h) + o(h) = e^{-a_S x h} + o(h) = 1 - a_S x h + o(h)$
- $P(S(t+h) = s+1 | S(t) = s, X(t) = x) = x(e^{-a_S(x-1)h} - e^{-a_S x h}) + o(h) = a_S x h + o(h)$
- $P(S(t+h) = s+2 | S(t) = s, X(t) = x) = o(h)$

$o(h)$ pojawia się już po pierwszej równości ze względu na to, że przy dokładnym rozpisaniu prawdopodobieństw należałoby warunkować w którym momencie $X(t)$ się zmieni (X jest zależny od S), jednak ta różnica jest $o(h)$, więc po prostu jest zawarta w tym.

zatem

$$\begin{aligned} P(X(t+h) = x+1 | X(t) = x) &= \\ P(N(t+h) = n+1 | N(t) = n) \cdot P(S(t+h) = s | S(t) = s, X(t) = x) &= \\ (a_N h + o(h)) \cdot (1 - a_S x h + o(h)) &= \\ a_N h + o(h) \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} P(X(t+h) = x-1 | X(t) = x) &= \\ P(N(t+h) = n | N(t) = n) \cdot P(S(t+h) = s+1 | S(t) = s, X(t) = x) &= \\ (1 - a_N h + o(h)) \cdot (a_S x h + o(h)) &= \\ a_S x h + o(h) \end{aligned}$$

Czyli mamy

- $P(X(t+h) = x+1 | X(t) = x) = a_N h + o(h)$
- $P(X(t+h) = x-1 | X(t) = x) = a_S x h + o(h)$

wzory te razem z $Q(x, x) = -a_N h - a_S x h$ i zerami w pozostałych wierszach opisują intensywność przejść procesu Markowa

3 Symulacje

3.1 Algorytm

Algorytm symulacji składa się z dwóch części:

1. standardowa symulacja procesu Poissona (czasy narodzin)
2. symulacja czasów życia z rozkładu wykładniczego o parametrze a_S

Konkretnie:

Gen $N \sim Poiss(a_N t)$

for $i = 1$ to N do Gen $U_i \sim U(0, t)$, Gen $L_i \sim Exp(1/a_S)$

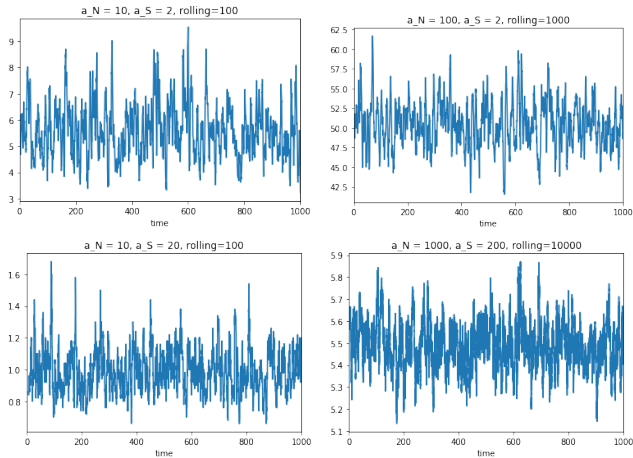
$(T_1, \dots, T_n) = \text{Sort}(U_1, \dots, U_n)$ otrzymujemy proces Poissona, czasy narodzin

$(D_1, \dots, D_n) = (T_1 + L_1, \dots, T_n + L_n)$ - dodajemy niezależne czasy życia do czasów narodzin i mamy czasy śmierci.

3.2 Przykładowe trajektorie

Wygenerowane wykresy są sparametryzowane 3 parametrami:

- $a_- N - a_N$
- $a_- S - a_S$
- rolling - długość horyzontu średniej kroczącej, średnia krocząca jest konieczna dla wielu wykresów ze względu na ogromną ilość punktów na wykresie. Pokazuje jednak ona "gęstość" punktów.



Rysunek 1: Przykładowe trajektorie symulacji

W trajektoriach należy także zwrócić uwagę na skalę, gdyż ona odgrywa kluczową rolę.

Od razu widać, że wyróżnioną liczbą jest $\frac{a_N}{a_S}$. Proces oscyluje w jej okolicach, co jest zrozumiałe po spojrzeniu na prawa ewolucji. Mówią one, że punkt $\frac{a_N}{a_S}$ jest punktem granicznym dla którego intensywność śmierci jest taka sama jak intensywność narodzin.

Możnaby pokusić się o alternatywną parametryzację procesu za pomocą parametrów $a = \frac{a_N}{a_S}$ i $b = a_S$, wtedy a reprezentowałaby punkt w okół którego symulacja będzie oscylować, a b reprezentowałaby gęstość punktów.

Skyupmy się teraz na dwóch procesach o tym samym parametrze $a(\frac{a_N}{a_S})$. Są widoczne na pierwszym i ostatnim wykresie wyżej ($\frac{a_N}{a_S} = 5$). Na wykresach widać po pierwsze większy parametr rolling który jest konieczny ze względu na większą gęstość punktów. Z tych wykresów możnaby też odczytać, że gęstszy wykres ma mniejsze odchylenia, jednak byłoby to błędne, gdyż jest to spowodowane jedynie wygładzeniem przez średnią kroczącą.

4 Analiza

4.1 Istnienie rozkładu stacjonarnego

4.2 Wartość oczekiwana

4.3 Wyliczenie rozkładu stacjonarnego