

UNIVERSIDADE DE SÃO PAULO - INSTITUTO DE FÍSICA

Tópicos em Mecânica Estatística de Sistemas Complexos

*Uma abordagem mecânico-estatística de dois tópicos
de interesse em finanças, economia e sociologia.*

RAFAEL S. CALSAVERINI

SÃO PAULO
5 DE JANEIRO DE 2013

UNIVERSIDADE DE SÃO PAULO - INSTITUTO DE FÍSICA

Tópicos em Mecânica Estatística de Sistemas Complexos

*Uma abordagem mecânico-estatística de dois tópicos
de interesse em finanças, economia e sociologia.*

RAFAEL S. CALSAVERINI

Tese apresentada ao Instituto de Física da
Universidade de São Paulo para obten-
ção do título de Doutor em Ciências.

Orientador:

Prof. Dr. Nestor Felipe Caticha Alfonso

Co-Orientador:

Prof. Dr. Renato Vicente

SÃO PAULO
5 DE JANEIRO DE 2013

ESTE TRABALHO É LICENCIADO PELO AUTOR SEGUNDO UMA LICENÇA CREATIVE COMMONS 3.0, CC-BY-SA, DESCRITA NESTA PÁGINA: <http://creativecommons.org/licenses/by-sa/3.0/br/>. Isso significa que você está livre para usar este trabalho, criar trabalhos derivados, e compartilhar os resultados com quem quiser, desde que atribua corretamente os créditos ao autor e compartilhe qualquer trabalho derivado usando a mesma licença.

CIÊNCIA BOA É COMPARTILHADA DE FORMA LIVRE, USE CREATIVE COMMONS!!!



CONTEÚDO

Resumo 9

Abstract 11

1 *Introdução* 13

1.1	Visão geral	13
1.2	Inferência, Probabilidades e Entropia	13
1.2.1	Probabilidades e Inferência	14
1.2.2	Informação e Máxima Entropia	16
1.2.3	Informação e Vínculos - atualização Bayesiana . .	18
1.2.4	Informação e vínculos - distribuições de Gibbs . .	19
1.2.5	Métodos de campo médio	20
1.3	Tópicos tratados na Tese	21
1.3.1	Teoria de Dependência Estatística, Cópulas e Teoria de Informação	21
1.3.2	Um modelo Mecânico-Estatístico para a emergência de autoridade	22

2 *Informação mútua, teoria de cópulas e dependência estatística* 23

2.1	Dependência Estatística e medidas de dependência . . .	23
2.1.1	O que se deseja de uma medida de dependência?	25
2.2	Informação Mútua	26
2.3	Cópulas	28
2.3.1	Exemplos	29
2.3.2	Dependência extrema - limites de Frechet-Hoeffding	30
2.3.3	Medidas de dependência revisitadas	31
2.4	Entropia de Cópula	32

2.5	“Excesso” de informação mútua	33
2.5.1	Correlação Linear <i>vs.</i> parâmetro ρ	33
2.5.2	Informação mútua para cópulas elípticas	34
2.5.3	Excesso de Informação Mútua	38
2.5.4	Ajuste empírico de cópulas via informação mútua	39
2.5.5	Cópula t	43
2.6	Conclusões	45

3 *Um Modelo para emergência de autoridade em sociedades humanas.* 47

3.1	Introdução	47
3.2	Evidências empíricas	48
3.2.1	“U-shaped evolution”	48
3.2.2	Evolução do cérebro primata e a Teoria Maquia- vética	48
3.3	Um modelo mecanico-estatístico baseado em agentes	49
3.3.1	Descrição dos agentes	49
3.3.2	Variáveis dinâmicas - grafos sociais	51
3.3.3	Custos	52
3.3.4	Dinâmica para agentes isolados - máxima entropia	53
3.3.5	Minimização do custo	53
3.3.6	Interpretação dos parâmetros α e β	54
3.3.7	Resultados numéricos para agentes isolados	55
3.3.8	Aproximação de Campo Médio	58
3.3.9	Interpretação parcial dos resultados	59
3.3.10	Dinâmica para muitos agentes e resultados nu- méricos	61
3.4	Sumarização e interpretação dos Resultados	63
3.4.1	Grupos pequenos e/ou alta capacidade cognitiva	63
3.4.2	Grupos de tamanho intermediário e/ou capaci- dade cognitiva intermediária	63
3.4.3	Grupos grandes e/ou capacidade cognitiva menor	63

4 *Conclusão e Observações Finais* 65

4.1	65
4.2	65
4.3	65

5 *Bibliografia* 67

A	<i>Provas dos teoremas de Cox</i>	73
	A.1 Primeiro teorema de Cox e a regra do produto	73
	A.2 Valores extremos	73
	A.3 Teorema de Bayes	74
	A.4 Regra da soma	74
B	<i>Propriedades de grafos do Ensemble de Erdős-Rényi</i>	77

LISTA DE FIGURAS

2.1	Representação pictórica da projeção de uma distribuição.	27
2.2	A correlação linear é subestimada no caso de marginais não-Gaussianas.	34
2.3	Estimativas para a informação mútua <i>vs.</i> tau de Kendall para séries financeiras.	40
2.4	Seleção de pares de ações.	41
2.5	Excesso de informação mútua na cópula t	45
3.1	Ilustração da história da organização social dos humanos e primatas pré-humanos.	48
3.2	Gráfico em escala di-logaritimica do tamanho médio do grupo em função da razão média entre o volume do neo-córtex e o volume total do cérebro para diversas espécies de primatas.	49
3.3	Grafo totalmente conectado	51
3.4	Grafo estrela	51
3.5	Corte do diagrama de fases apresentando o valor esperado dos parâmetros de ordem.	55
3.6	Diagrama de fases apresentando a razão $\frac{d_{avg}}{d_{max}}$ em função de α e temperatura, para um número fixo de agentes. . .	56
3.7	Valor crítico do parâmetro a em função da temperatura para diferentes tamanhos do sistema.	57
3.8	Taxa de aceitação do algoritmo de Monte Carlo - fração das propostas de mudanças no microestado do sistema que foram aceitas com probabilidade dada pelo fator de Gibbs, sampleada com $\beta = 1.0$	58
3.9	Comparação do resultado de campo médio obtido pela maximização numérica da energia livre 3.15 e do resultado de Monte Carlo. O resultado é blabla.	59
3.10	Corte do diagrama de fase para vários tamanhos do grupo. 60	
3.11	Finite size scaling do modelo.	61
3.12	Parâmetros de ordem associados à correlação entre grafos de diferentes agentes	62

RESUMO

NESTE TRABALHO, exploramos dois tópicos de aplicação de teoria de informação e mecânica estatística a problemas de interesse em finanças, economia e sociologia. No primeiro tópico, exploramos a conexão entre a teoria de dependência estatística e a teoria de informação através da teoria de cópulas. Após uma revisão do conceito de cópulas, reformulamos a definição de medidas de dependência de Rényi¹ usando esse conceito e mostramos que a informação mútua satisfaz todos os requisitos para ser uma medida de dependência. Em seguida, mostramos uma relação entre a informação mútua e a entropia da distribuição cópula e uma relação mais específica para a decomposição da informação mútua de distribuições elípticas, em uma parte devido à dependência gaussiana linear e outra parte não-linear. As consequências dessas duas decomposições sobre o risco do uso de pseudo-medidas de dependências são então discutidas. Esses resultados são usados para desenvolver um método para detectar desvio de gaussianidade na dependência de séries temporais e para ajuste de cópulas t sobre dados empíricos².

NO SEGUNDO TÓPICO, desenvolvemos um modelo para emergência de autoridade em sociedades humanas. Discutimos as motivações empíricas com raízes na neurociência, na primatologia e na antropologia para um modelo matemático que explique o espectro amplo de tipos de organização social humana no eixo igualitário-hierárquico. O modelo resulta da aplicação de teoria de informação sobre uma hipótese sobre os custos evolutivos envolvidos. O modelo apresenta um diagrama de fases rico, com diferentes regimes que podem ser interpretadas como correspondendo a diferentes tipos de organização social, desde igualitária até hierárquica. Os parâmetros de controle do sistema são identificados com a capacidade cognitiva da espécie em questão e as pressões ecológica e social em que o grupo está imerso.

¹ A. Rényi. On measures of dependence. *Acta. Math. Acad. Sci. Hungar.*, 10:441–451, 1959

² R. S. Calsaverini and R. Vicente. An information-theoretic approach to statistical dependence: Copula information. *EPL (Europhysics Letters)*, 88(6): 68003, 2009. URL <http://stacks.iop.org/0295-5075/88/i=6/a=68003>

ABSTRACT

IN THIS WORK, we explore two topics of interest in the application of information theory and statistical mechanics techniques to problems in finance, economics and sociology. In the first topic, we study the connexion between statistical dependency theory and information theory mediated by copula theory. After a revision of the concept of copulas, we reformulate the definition of dependency measures given by Rényi³ using this concept and show that mutual information satisfies all the requirements to be a dependency measure. We then show a relationship between mutual information and copula entropy and a more specific decomposition of the mutual information of an elliptical distribution into its linear and non-linear parts. We evaluate the risk of using naive pseudo-dependency measures. Those results are then used to develop a method to detect deviation from gaussianity in the dependency of time series and a method to adjust t-copulas to data⁴.

ON THE SECOND TOPIC, we develop a model for the emergence of authority in early human societies. We discuss empirical motivations with roots in neuroscience, primatology and anthropology for a mathematical model able to explain the spectrum of observed types of human social organization in the egalitarian-hierarchical axis. The model results from the application of information theory on a hypothesis about the evolutive costs involved in social life. The model generates a rich phase diagram, with different regimes which can be interpreted as different types of societal organization, from egalitarian to hierarchical. The control parameters of the model are connected to the cognitive capacity of the species in question and ecological and social pressures.

³ A. Rényi. On measures of dependence. *Acta. Math. Acad. Sci. Hungar.*, 10:441–451, 1959

⁴ R. S. Calsaverini and R. Vicente. An information-theoretic approach to statistical dependence: Copula information. *EPL (Europhysics Letters)*, 88(6): 68003, 2009. URL <http://stacks.iop.org/0295-5075/88/i=6/a=68003>

[1] INTRODUÇÃO

[1.1] VISÃO GERAL

ESTE TRABALHO TRATA DE DOIS TÓPICOS – uma abordagem da teoria de dependência estatística e um modelo para a origem de estruturas sociais hierárquicas – sob o ponto de vista da mecânica estatística, da teoria de informação e da inferência estatística. A adoção desse ponto de vista norteia as estratégias de modelagem matemática aqui selecionadas, e de uma certa forma, são mais essenciais ao trabalho do que os específicos tópicos em si. Dessa forma se faz necessário explicitar e esclarecer o ponto de vista adotado antes que os tópicos específicos sejam apresentados.

[1.2] INFERÊNCIA, PROBABILIDADES E ENTROPIA

ADQUIRIR INFORMAÇÃO E TOMAR DECISÕES SOB INCERTEZA – dois pontos centrais em qualquer estudo quantitativo – são os temas centrais da teoria da inferência estatística. A tradição do uso da teoria de probabilidades como ferramenta de inferência é centenária e já observada em trabalhos como os de de Moivre [3] e Laplace [4, 5] sobre o conceito de probabilidades nos séculos XVIII e XIX. A relação entre o conceito de probabilidade e os problemas de inferência ficaram ainda mais fortes com os trabalhos de Cox [6]¹ e Shannon [8]², e as versões mais modernas desse paradigma³ lançam luz sobre a natureza da física estatística e do conceito de entropia⁴. Nessa introdução pretendemos apresentar rapidamente o paradigma de inferência segundo o método de Máxima Entropia (ME) e suas relações com a mecânica estatística, que pensamos ser a linha unificadora que dá coerência à diversidade de temas abordados nesse trabalho.

RACIOCÍNIO SOBRE INFORMAÇÃO COMPLETA a respeito da veracidade ou não de um conjunto de proposições pode ser representado através da tradicional álgebra booleana. Se é conhecido o valor de

¹ R. T. Cox. Probability, frequency, and reasonable expectation. *Am. Jour. Phys.*, 14:1–13, 1946; and R.T. Cox. *Algebra of Probable Inference*. Johns Hopkins University Press, 2001. ISBN 9780801869822. URL <http://books.google.com.br/books?id=dcNpAUU6ACgC>

² C. E. Shannon. A mathematical theory of communication. *Bell System Technical Journal*, 47:379–423 and 623–656, 1948

³ E.T. Jaynes and G.L. Bretthorst. *Probability Theory: The Logic of Science*. Cambridge University Press, 2003. ISBN 9780521592710. URL <http://books.google.com.br/books?id=tTN4HuUxnjgC>

⁴ Ariel Caticha. Lectures on probability, entropy, and statistical physics. arxiv:0808.0012, 2008. URL <http://arxiv.org/abs/0808.0012>. Invited lecture at the 28th International Workshop on Bayesian Inference and Maximum Entropy Methods in Science and Engineering (July 8–13, 2008, Boraceia Beach, Sao Paulo, Brazil); and Ariel Caticha. Quantifying rational belief. arxiv:0908.3212, 2009. URL <http://arxiv.org/abs/0908.3212>. Presented at the 29th International Workshop on Bayesian Inference and Maximum Entropy Methods in Science and Engineering (July 5–10, 2009, Oxford, Mississippi, USA.) In

verdade de uma certa proposição e como ela se relaciona com outras proposições, pode-se inferir o valor de verdade das proposições relacionadas através das regras bem definidas da álgebra de proposições. Por exemplo, se é sabido que $P_1 \Rightarrow P_2$, e há certeza de que P_1 é verdadeira, pode-se inferir imediatamente que P_2 é verdadeira. Da mesma forma, a certeza de que P_2 é falsa imediatamente implica na certeza de que P_1 é falsa. Em outras palavras, a hipótese $P_1 = V$ fornece *informação completa* a respeito de P_2 , bem como a hipótese $P_2 = F$ fornece informação completa sobre P_1 . Entretanto, a certeza a respeito da falsidade de P_1 não oferece conclusão alguma, dentro desse paradigma de inferência sobre informação completa, a respeito da veracidade de P_2 . Não é difícil porém formular um exemplo em que a informação sobre a falsidade de P_1 fornece *alguma informação*, ainda que incompleta, sobre P_2 .

CONSIDEREMOS, EM UM EXEMPLO SIMPLES, a hipótese de que a proposição P_1 = “vai chover” implica a proposição P_2 = “há nuvens de chuva”. No *ambiente lógico* criado por essa hipótese, a observação de nuvens de chuva não leva à conclusão certa de que está chovendo, mas é uma decisão razoável carregar um guarda-chuvas ao se observar essas nuvens. De alguma forma, a observação de que há nuvens de chuva trouxe alguma informação ao observador a respeito da possibilidade de que chova. Construir um método de inferência capaz de levar em conta informação incompleta é o objetivo da teoria de probabilidades bayesiana e do método de máxima entropia.

[1.2.1] PROBABILIDADES E INFERÊNCIA

PARA DERIVAR UMA TEORIA COERENTE DE INFERÊNCIA, devem ser estabelecidos alguns requisitos. Dada duas proposições P e Q , postulamos uma medida $(P|Q) \in \mathbb{R}$ denominada *plausibilidade*^{5,6} da proposição P dada a proposição Q . A plausibilidade $(P|Q)$ representa o *grau de confiança* de que P esteja correta dada uma certa informação prévia Q . Postulamos ainda que, sempre que existam duas formas diferentes de calcular a mesma plausibilidade, o resultado deve ser idêntico. Esse requisito leva aos seguintes resultados^{7,8}:

- A plausibilidade⁹ de não- P dado Q é uma função monotônica e decrescente da plausibilidade de P dado Q :

$$(\bar{P}|Q) = F((P|Q)).$$

- A plausibilidade da conjunção “ P_1 e P_2 ” ($P_1 \wedge P_2$) dado Q é uma função das plausibilidades de P_1 dado Q e de P_2 dado $P_1 \wedge Q$:

$$(P_1 \wedge P_2|Q) = G((P_1|Q), (P_2|Q \wedge P_1)).$$

⁵ A justificativa para usar números reais vem de um argumento simples de transitividade - se a confiança na veracidade de P_1 é maior que na veracidade de P_2 e esta é maior que a confiança na veracidade de P_3 , então, um requisito razoável é que a confiança em P_1 seja maior que em P_3 . Dessa forma, $(P_1|Q) > (P_2|Q)$ e $(P_2|Q) > (P_3|Q)$ implica $(P_1|Q) > (P_3|Q)$. Isso é suficiente para mostrar que existe uma representação real para essas quantidades. Consequências interessantes de se relaxar o requisito de transitividade e considerar plausibilidades representadas por números complexos são discutidas em Goyal et al. [12]

⁶ Philip Goyal, Kevin H. Knuth, and John Skilling. Origin of complex quantum amplitudes and Feynman's rules. *Phys. Rev. A*, 81:022109, Feb 2010. DOI: 10.1103/PhysRevA.81.022109. URL <http://link.aps.org/doi/10.1103/PhysRevA.81.022109>. arxiv:0907.0909

⁷ Todas as outras possibilidades são consideradas em Tribus [13] e essas são as únicas que não conduzem a resultados manifestamente inconsistentes.

⁸ M. Tribus. *Rational descriptions, decisions, and designs*. Pergamon unified engineering series: engineering design section. Pergamon Press, 1969. URL <http://books.google.com.br/books?id=C4pRAAAMAAJ>

⁹ Os seguintes símbolos serão usados para as operações booleanas no presente capítulo:

Conjunção - \wedge : representa a conjunção “e” entre duas proposições: $P \wedge Q$, lido “p e q”.

Disjunção - \vee : representa a disjunção “ou” entre duas proposições: $P \vee Q$, lido “p ou q”.

Negação - \neg : representa a negação “não” de uma proposição: \bar{P} , lido “não-p”.

UMA SÉRIE DE TEOREMAS sobre a forma das funções $F(\cdot)$ e $G(\cdot, \cdot)$ podem ser demonstrados com o requisito de consistência e as regras básicas da álgebra booleana. Alguns dos principais teoremas, cujas provas se encontram no apêndice A, *Provas dos teoremas de Cox*, são:

1º teorema de Cox

Teorema 1. *Uma vez que uma representação consistente de plausibilidades $(P|Q)$ com um ordenamento bem definido foi encontrada, sempre é possível encontrar uma outra equivalente $\pi(P|Q)$ de forma que $G(u, v) = uv$, ou seja:*

$$\pi(P_1 \wedge P_2|Q) = \pi(P_2|Q \wedge P_1)\pi(P_1|Q) \quad (1.1)$$

Valores limites para plausibilidades

Teorema 2. *Uma vez que uma representação consistente de plausibilidades $\tilde{\pi}(P|Q)$ que satisfaça a regra do produto, é sempre possível encontrar uma equivalente $\pi(P|Q)$ tal que:*

$$0 \leq \pi(P|Q) \leq 1 \quad (1.2)$$

de tal forma que $\pi(P|Q) = 0$ se, e somente se, P for uma proposição falsa dado Q e $\pi(P|Q) = 1$ se, e somente se, P for uma proposição verdadeira dado Q .

2º teorema de Cox

Teorema 3. *Uma vez que uma representação consistente de plausibilidades $\pi(P|Q)$ com um ordenamento bem definido foi encontrada para a qual vale a regra do produto, sempre é possível encontrar uma outra equivalente $p(P|Q)$, que também satisfaz a regra do produto, de forma que $F(u) = 1 - u$, ou seja:*

$$p(\bar{P}|Q) + p(P|Q) = 1 \quad (1.3)$$

TOMADOS EM CONJUNTO, esses teoremas sugerem que as regras de uma álgebra de plausibilidades deve ser idêntica às conhecidas regras da Teoria das Probabilidades. A partir de agora portanto daremos o nome “probabilidade” ao funcional $p(P|Q)$, e interpretaremos probabilidades como formas de codificar matematicamente graus de certeza a respeito de certas proposições. Quando essas proposições são afirmações sobre o valor de uma variável matemática x que toma valores sobre um conjunto \mathcal{X} , definem-se distribuições de probabilidade¹⁰ sobre o valor dessas variáveis:

$$P(x \in s|Q) = \int_{x \in s} p(x|Q) dx \quad (1.4)$$

Para qualquer subconjunto $s \subset \mathcal{X}$. Um modelo matemático, nesse paradigma, é portanto uma atribuição de distribuições de probabilidade para as variáveis de interesse do modelo, indicando graus de confiança sobre os valores dessas variáveis sob certas condições.

¹⁰ Note que a equação (1.3) implica que:

$$\int p(x|Q) dx = 1$$

[1.2.2] INFORMAÇÃO E MÁXIMA ENTROPIA

SE MODELOS DE INFERÊNCIA são atribuições de probabilidades sobre as variáveis de interesse, como é possível fazer isso a partir de informação pré-existente sobre o sistema sendo modelado, ou ainda, como é possível incorporar novas informações obtidas sobre o sistema? Eventualmente, o objetivo de realizar inferência é processar informação nova que nos é disponibilizada depois da realização de um certo experimento ou observação. No presente paradigma isso significa atualizar nossa atribuição de probabilidades. Suponha a proposição $P_s = \text{“A variável } X \in \mathcal{X} \text{ tem seu valor no subconjunto } s \subset \mathcal{X}\text{”}$. Suponha ainda que, inicialmente, há um certo conjunto de informações *a priori*, representadas por I_0 , que nos levam a crer que nossa atribuição inicial de probabilidades deve ser:

$$p(P_s|I_0) = \int_{x \in s} p(x) dx.$$

UMA VEZ QUE TORNE-SE DISPONÍVEL uma nova informação, digamos I_1 , que nos force a mudar de opinião a respeito da atribuição de probabilidades, qual deve ser a nova distribuição a ser utilizada? Vamos representar simbolicamente por \mathbb{P} o conjunto de todas as distribuições sobre a variável x . Digamos ainda que fosse possível ordenar as distribuições $q(x) \in \mathbb{P}$ em ordem de preferência como nova distribuição a ser atribuída a P_x . Se essa preferência for transitiva, existe um funcional $S : \mathbb{P} \rightarrow \mathbb{R}$ que representa esse ordenamento e a nova distribuição será obtida através da maximização do funcional $S[\cdot]$:

$$P(P_s|I_1) = \int_{x \in s} q(x) dx$$

$$q(x) = \arg \max_{\tilde{q}(x) \in \mathbb{P}} S[\tilde{q}(x)|p(x)],$$

onde a maximização deve ser submetida a quaisquer vínculos impostos pela nova informação I_1 . É possível impor requisitos plausíveis sobre $S[\cdot]$ de forma a definir um único funcional compatível com uma atualização racional de crenças (probabilidades)? De fato é possível impondo apenas um requisito: as crenças devem ser atualizadas apenas até onde requerido pela nova informação disponível. Resumidamente (detalhes podem ser obtidos em Caticha [10]), esse princípio leva às seguintes consequências:

Localidade – Se a nova informação diz respeito apenas a um subdomínio do espaço onde X toma valores, então a atribuição de probabilidades fora desse subdomínio não deve mudar. Isso implica que o funcional deve ser aditivo:

$$S[q|p] = \int_{\mathcal{X}} d\mu(x) F(q(x), p(x), x)$$

onde $\mu(x)$ é uma medida de integração sobre \mathcal{X} .

Invariância por mudança de variáveis – Uma mudança de sistema de coordenadas não deve mudar a forma do funcional S e nem a ordem das preferências. Isso implica que:

$$S[q|p] = \int_{\mathcal{X}} d\mu(x) \Phi \left(\frac{p(x)}{\mu(x)}, \frac{q(x)}{\mu(x)} \right)$$

Ausência de nova informação – Se não há nova informação, não há razão para mudar de idéia e, portanto, o máximo sem vínculos de $S[\cdot|\cdot]$ deve ser a própria distribuição original $p(x)$. Isso implica que:

$$S[q|p] = \int_{\mathcal{X}} dx p(x) \Phi \left(\frac{q(x)}{p(x)} \right)$$

Sistemas independentes Se a distribuição $p(x)$ contém informação de que dois subsistemas X_1 e X_2 são independentes, nova informação a respeito de um deles não deve afetar o outro. Esse princípio leva a uma equação funcional para $\Phi(x)$ que finalmente implica que:

$$S[q(x)|p(x)] = - \int_{\mathcal{X}} dx q(x) \log \frac{q(x)}{p(x)} \quad (1.5)$$

ESSE FUNCIONAL é conhecido em Teoria de Informação¹¹ e é denominado “entropia relativa”. Os passos acima levam à formulação do princípio de máxima entropia¹²:

Princípio da Máxima Entropia. *Dada uma atribuição inicial de probabilidades sobre uma variável $X \in \mathcal{X}$ dada por $p(x)$ (distribuição a priori, ou prévia), quando nova informação se torna disponível, uma nova distribuição de probabilidades deve ser atribuída de forma a maximizar a entropia relativa entre a antiga distribuição $p(x)$ e a nova $q(x)$ (distribuição posterior), de forma a satisfazer os vínculos impostos pela nova informação.*

$$q(x) = \arg \max_{q(x)} S[q(x)|p(x)] \quad (1.6)$$

$$F_i[q(x)] = 0, i = 1, 2, \dots, m \quad (1.7)$$

onde $F_i[\cdot]$ são funcionais que codificam os vínculos relacionados às informações disponíveis.

UMA VEZ QUE O FUNCIONAL $S[q|p]$ é convexo, se os vínculos forem também convexos o máximo será interior e único, e pode ser encontrado pela técnica de multiplicadores de Lagrange, resolvendo para $q(x)$ a condição variacional de primeira ordem:

$$\frac{\delta}{\delta q(x)} \left(S[q|p] - \sum_i \lambda_i F_i[q] \right) = 0 \quad (1.8)$$

¹¹ T.M. Cover and J.A. Thomas. *Elements of Information Theory*. Wiley, 2006. ISBN 9780471748816. URL <http://books.google.com.br/books?id=EuhBluW31hsC>

¹² Os nomes atribuídos às distribuições são traduções do inglês *prior distribution* e *posterior distribution*

A ENTROPIA RELATIVA na eq.(1.5) também pode ser ligada a outro conceito corrente em teoria de informação e geometria de distribuições de probabilidade, denominado divergência de Kullback-Leibler¹³:

$$D[q(x)|p(x)] = \int_{\mathcal{X}} dx \, q(x) \log \frac{q(x)}{p(x)} = -S[q(x)|p(x)]. \quad (1.9)$$

A divergência de Kullback-Leibler apresenta as propriedades de uma pré-métrica, ou seja: $D[q(x)|p(x)] \geq 0$ e $D[q(x)|p(x)] = 0$ se, e somente se, $q(x) = p(x)$, no sentido de igualdade de distribuições¹⁴. Nessa linguagem, o princípio de máxima entropia pode ser entendido como um princípio de “mínima distância” – a distribuição posterior deve ser tão próxima da distribuição *a priori* quanto permitido pelos vínculos impostos pela nova informação.

[1.2.3] INFORMAÇÃO E VÍNCULOS - ATUALIZAÇÃO BAYESIANA

UM CASO ESPECÍFICO DE APLICAÇÃO do princípio de Máxima Entropia é o da ajuste de parâmetros teóricos de um modelo quando novos dados empíricos são coletados. Suponha que um par de variáveis X e Θ são considerados em um modelo M . A variável X é experimentalmente mensurável e a variável Θ é um parâmetro teórico do modelo. O modelo oferece informação prévia sob a forma de (1) uma distribuição *a priori* dos valores possíveis do parâmetro Θ , dada por $p(\theta|M)$ e (2) uma distribuição condicional *a priori* $p(x|\theta, M)$ que indica, dado um valor do parâmetro $\Theta = \theta$, os possíveis resultados para X . Eventualmente o valor de X é medido, com resultado $X = x_0$. Como devemos atualizar nossa atribuição de probabilidades? O princípio da máxima entropia indica que a distribuição posterior $q(x, \theta)$ é aquela que maximiza o funcional da eq.(1.5) sob o vínculo de que conhecemos o valor de X . Ou seja, o vínculo é dado por¹⁵:

$$\int q(x, \theta) d\theta = q(x) = \delta(x - x_0). \quad (1.10)$$

A distribuição *a priori* sobre x e θ é dada por $p(x, \theta|M) = p(x|\theta, M)p(\theta|M)$. Finalmente, a minimização é dada por:

$$\begin{aligned} \frac{\delta}{\delta q} \left[S[q|p] + \lambda \left(\int dx d\theta \, q(x, \theta) - 1 \right) \right. \\ \left. + \int dx \, \beta(x) \left(\int d\theta q(x, \theta) - \delta(x - x_0) \right) \right] = 0 \end{aligned}$$

onde λ e $\beta(x)$ são multiplicadores de Lagrange que implementam, respectivamente, o vínculo de normalização de $q(x, \theta)$ e os vínculos

¹³ S. Amari, H. Nagaoka, and D. Harada. *Jōhō Kika No Hōhō (Methods of Information Geometry)*. Translations of mathematical monographs v. 191. Amer Mathematical Society, 2000. ISBN 9780821843024. URL <http://books.google.com.br/books?id=vc2FWSo7wLUC>

¹⁴ Entretanto, por não ser simétrica e não satisfazer a desigualdade do triângulo, $D[q|p]$ não é uma métrica legítima para o conjunto de distribuições de probabilidades. Se restrita a uma família paramétrica \mathcal{P}_θ de distribuições parametrizadas por um certo conjunto de parâmetros θ (denotada por $p(x|\theta)$), podemos escrever:

$$\begin{aligned} D[p(x|\theta + d\theta), p(x|\theta)] = \\ = \frac{1}{2} \sum_{ij} g_{ij} d\theta_i d\theta_j + O(d\theta^3), \end{aligned}$$

onde

$$g_{ij} = \left\langle \frac{\partial \log p(x|\theta)}{\partial \theta_i} \frac{\partial \log p(x|\theta)}{\partial \theta_j} \right\rangle$$

é a chamada métrica de Fisher-Rao, que provê uma estrutura métrica (veja Amari et al. [15]) ao conjunto \mathcal{P}_θ .

¹⁵ Note que essa equação implementa, na verdade, um número infinito de vínculos – um para cada valor de x .

impostos pela eq.(1.10). Executando essa diferenciação funcional e isolando $q(x, \theta)$, obtemos¹⁶:

$$q(x, \theta|M) = p(x, \theta|M) \frac{e^{\beta(x)}}{Z} = p(\theta|x, M)p(x|M) \frac{e^{\beta(x)}}{Z} \quad (1.11)$$

onde Z é uma constante de normalização. Impondo o vínculo eq.(1.10), finalmente obtém-se:

$$\begin{aligned} q(x, \theta|M) &= q(x|M)q(\theta|x, M) = \delta(x - x_0)p(\theta|x, M) \\ &\Rightarrow q(\theta|x_0, M) = p(\theta|x_0, M) \end{aligned}$$

Ou seja, as distribuições condicionais de θ devem ser iguais antes e depois de receber a informação, pois apenas informação a respeito de x – informação marginal, que diz respeito apenas à distribuição marginal de x – foi recebida. Isso é consequência do princípio de mínima atualização usado na dedução do princípio de máxima entropia: apenas se deve atualizar as probabilidades quando isso é imposto pela nova informação recebida. Essa equação pode ser reescrita como:

$$q(\theta|x_0, M) = \frac{p(x_0|\theta, M)p(\theta, M)}{p(x_0|M)} \quad (1.12)$$

e esse é o teorema de Bayes como entendido em inferência bayesiana – como um princípio de atualização de graus de confiança quando uma nova informação está disponível. A distribuição $q(\theta|x_0, M)$ incorpora informações a respeito do modelo original e do fato de que a variável X foi medida e vale x_0 .

[1.2.4] INFORMAÇÃO E VÍNCULOS - DISTRIBUIÇÕES DE GIBBS

OUTRO TIPO DE POSSÍVEL de informação que pode ser incorporada à distribuição de probabilidades é a respeito do valor esperado de uma certa função de x :

$$\langle E(x) \rangle = E_0.$$

Nesse caso, a maximização da entropia será:

$$\begin{aligned} \frac{\delta}{\delta q} \left[S[q|p] - \lambda \left(\int dx q(x) - 1 \right) - \beta \left(\int dx q(x) E(x) - E_0 \right) \right] &= 0 \\ = -\log \left(\frac{q(x)}{p(x)} \right) - 1 - \lambda - \beta E(x) &= 0 \end{aligned}$$

e obtém-se finalmente:

$$q(x) = \frac{1}{Z} p(x) e^{-\beta E(x)} \quad (1.13)$$

A DISTRIBUIÇÃO (1.13) faz parte da classe de distribuições gibbsianas, comuns em mecânica estatística^{17,18}. Uma forma alternativa dessa vi-

¹⁶ O segundo passo é uma aplicação a definição de distribuição condicional

¹⁷ Esse raciocínio é remanescente do encontrado em textos clássicos de mecânica estatística como Landau et al. [16], onde a distribuição de probabilidades para um conjunto de partículas é encontrada maximizando a entropia sob vínculos associados a quantidades conservadas microscopicamente.

¹⁸ L.D. Landau, E.M. Lifshitz, and L.P. Pitaevskii. *Statistical Physics Pt. 1*, volume 6 of *Course of Theoretical Physics*. Elsevier Science & Technology Books, 1980. ISBN 9780750626361. URL <http://books.google.com.br/books?id=NaB7oAkon9MC>

são pode ser encontrada¹⁹ em Caticha and Vicente [17]. Nesse trabalho, os autores consideraram um modelo em que há uma função das variáveis microscópicas cujo valor deve ser importante determinante para uma dinâmica microscópica desconhecida. Ainda que não haja indicação de que essa deve ser uma grandeza estritamente conservada pela dinâmica interna dos agentes, há uma indicação de que o valor dessa função oferece informação sobre esta dinâmica. Isso é o suficiente para que a incorporação do valor dessa função na distribuição de probabilidades através de um vínculo traga informação útil.

¹⁹ Nestor Caticha and Renato Vicente. Agent-based social psychology: from neurocognitive processes to social data. *Advances in Complex Systems*, 14(05):711–731, 2011. DOI: 10.1142/S0219525911003190. URL <http://www.worldscientific.com/doi/abs/10.1142/S0219525911003190>

[1.2.5] MÉTODOS DE CAMPO MÉDIO

EVENTUALMENTE, podemos nos deparar com uma distribuição $p(x)$ que não conseguimos tratar analiticamente. Esse é frequentemente o caso das distribuições gibbsianas como as da eq.(1.13). Nesse caso, a interpretação do negativo da entropia relativa – a divergência de Kullback-Leibler – como espécie de distância pode oferecer um esquema aproximativo conveniente. Seja \mathcal{P}_Θ uma família de distribuições tratáveis analiticamente, parametrizada por um parâmetro Θ . Pode-se selecionar como aproximação uma das distribuições dessa família, maximizando a entropia relativa ou, de forma equivalente, minimizando a divergência de Kullback-Leibler. Assim, $p(x)$ será aproximada por $p(x|\tilde{\theta})$, onde:

$$\begin{aligned}\tilde{\theta} &= \arg \max_{\theta} D[p(x|\theta)|p(x)] \\ &= \arg \max_{\theta} \int p(x|\theta) \log \frac{p(x|\theta)}{p(x)}.\end{aligned}$$

NO CASO DE UMA DISTRIBUIÇÃO GIBBSIANA como eq.(1.13) temos:

$$D[p(x|\theta)|p(x)] = \int dx p(x|\theta) \log \left[p(x|\theta) \frac{Z}{e^{-\beta H(x)}} \right]$$

que pode ser ainda escrito como:

$$D[p(x|\theta)|p(x)] = -S(\theta) + \beta \langle H \rangle_{\theta} + \log(Z)$$

onde $S(\theta) = -\int dx p(x|\theta) \log p(x|\theta)$ é a entropia de Shannon da distribuição $p(x|\theta)$. Usando ainda a definição de energia livre termodinâmica, essa equação pode ser escrita como:

$$D[p(x|\theta)|p(x)] = \frac{F(\theta) - F}{T}. \quad (1.14)$$

onde $T = \frac{1}{\beta}$ é uma quantidade similar à temperatura e

$$F(\theta) = \langle H \rangle_{\theta} - TS(\theta) \quad (1.15)$$

e $F = -T \log(Z)$ são funções similares às energias livres da termodinâmica. Essa função deve ser otimizada com relação aos parâmetros θ para obter uma distribuição aproximativa. Uma vez que F independe do parâmetro θ , o parâmetro basta então maximizar a energia livre $F(\theta)$:

$$p(x) \cong p(x|\tilde{\theta}), \text{ onde: } \tilde{\theta} = \arg \max_{\theta} F(\theta) \quad (1.16)$$

SE A DISTRIBUIÇÃO ORIGINAL $p(x)$ pertence ao conjunto \mathcal{P}_{Θ} , as propriedades da divergência de Kullback-Leibler garantem que a solução do problema de otimização é a própria $p(x)$. Nesse caso, $D[p|p] = 0$ e a energia livre $F(\tilde{\theta})$ ótima é igual à energia livre exata. Caso contrário, a distribuição e energia livre ótimas são aproximações para a distribuição e energia livre exatas. Uma vez que a divergência de Kullback-Leibler nunca é negativa, a equação (1.14) resulta em:

$$F(\theta) \geq F, \quad (1.17)$$

mais uma versão da célebre desigualdade de Bogouliubov, familiar da teoria de aproximações de campo médio em mecânica estatística²⁰.

O EXEMPLO CLÁSSICO DESSE ESQUEMA APROXIMATIVO é a escolha da família de distribuições aproximativas como o conjunto de distribuições em que as variáveis x_1, x_2, \dots, x_N são independentes. Nesse caso, obtém-se o que tradicionalmente se chama em mecânica estatística uma aproximação de campo-médio. Diversos outros esquemas de aproximação, como a aproximação de Bethe-Peierls²¹, podem ser colocadas no mesmo esquema escolhendo famílias de distribuições adequadas²². Mais sobre aproximações de campo médio sob este ponto de vista pode ser encontrado em Oppen and Saad [19]²³ e Mézard and Montanari [20]²⁴.

[1.3] TÓPICOS TRATADOS NA TESE

AS IDÉIAS E PONTOS DE VISTA desenvolvidos acima norteiam o desenvolvimento de dois temas independentes no presente trabalho, que passarão a ser descritos agora.

[1.3.1] TEORIA DE DEPENDÊNCIA ESTATÍSTICA, CÓPULAS E TEORIA DE INFORMAÇÃO

A PRIMEIRA PARTE DA TESE trata de uma análise da relação entre três campos isolados sobre os quais trabalhos recentes lançam luz - a teoria de informação, a teoria de medidas de dependência estatística e a

²⁰ S.R. Salinas. *Introdução a Física Estatística*. EDUSP, 1997. ISBN 9788531403866. URL <http://books.google.com.br/books?id=cAlP3sc0K44C>

²¹ Também conhecida como “sum-product algorithm” ou “belief propagation”

²² Famílias de distribuições com vários graus diferentes de fatorização da dependência entre as variáveis.

²³ M. Oppen and D. Saad. *Advanced Mean Field Methods: Theory and Practice*. Neural Information Processing Series. MIT Press, 2001. ISBN 9780262150545. URL <http://books.google.com.br/books?id=cu0X8sCDeNAC>

²⁴ M. Mézard and A. Montanari. *Information, Physics, and Computation*. Oxford Graduate Texts. OUP Oxford, 2009. ISBN 9780198570837. URL <http://books.google.com.br/books?id=jhCM7i0a6UUC>

teoria de cópulas. Inicialmente, discutimos uma definição de medidas de dependência e concordância devida a Renyi [1] e mostramos como essa definição pode ser reescrita usando o conceito de cópula. Em particular, mostramos que boas medidas de dependência devem ser funcionais da função cópula, e independentes das distribuições marginais.

A SEGUIR, demonstramos que a Informação Mútua respeita todas os requisitos da definição de Renyi [1] e que, de fato, pode ser escrita como a entropia de Shannon da densidade de cópula, o que leva à decomposição da entropia conjunta das variáveis a uma parte relacionada às distribuições marginais e outra associada à dependência entre as variáveis. As consequências desse fato são discutidas para o caso comum do uso da correlação linear como medida de dependência, bem como os problemas associados a esse uso quando as distribuições marginais não são normais.

POSTERIORMENTE o caso particular da família de distribuições elípticas é estudado e é demonstrada uma decomposição da informação mútua dessa família de distribuições em duas partes - uma relacionada à parte linear da dependência e outra relacionada à parte não-linear. É então introduzido o conceito de “excesso de informação mútua” como medida do desvio da dependência com relação a uma dependência puramente normal e linear. Uma técnica para medida desse desvio para distribuições elípticas é introduzida e aplicada para o caso da dependência entre pares de ações que compõe o índice *S&P500*, onde identificamos pares de ações com dependências que desviam fortemente da normalidade (ou linearidade).

POR FIM, discutimos um método para ajuste empírico de cópulas e testamos esse método para uma particular sub-família das cópulas elípticas - as cópulas *t*, derivadas da distribuição *t* de Student.

[1.3.2] UM MODELO MECÂNICO-ESTATÍSTICO PARA A EMERGÊNCIA DE AUTORIDADE

[2] INFORMAÇÃO MÚTUA, TEORIA DE CÓPULAS E DEPENDÊNCIA ESTATÍSTICA

[2.1] DEPENDÊNCIA ESTATÍSTICA E MEDIDAS DE DEPENDÊNCIA

O CONCEITO DE DEPENDÊNCIA ESTATÍSTICA é central à teoria de probabilidades. Fazer hipóteses a respeito da dependência estatística entre as variáveis de interesse em um modelo é comum em diversas áreas – da física à análise financeira. Não é óbvio, entretanto, como expressar esse conceito de maneira precisa. A formalização precisa desse conceito é um dos objetivos desse capítulo. De maneira informal e grosseira, dependência estatística diz respeito a quanta *informação* se obtém a respeito de uma variável quando o valor de outra variável é conhecido. Os dois casos extremos podem ser mais facilmente entendidos em primeira análise: o caso de completa independência e o caso de completa dependência. Duas variáveis são ditas independentes se sua distribuição conjunta pode ser fatorada em um produto¹:

$$p_{X,Y}(x,y) = p_X(x)p_Y(y). \quad (2.1)$$

De maneira similar, pode-se dizer que duas variáveis são independentes quando a distribuição condicional $p(x|y)$ é idêntica à distribuição marginal de X - $p_X(x)$. Nessa situação, o conhecimento do valor da variável Y não fornece qualquer informação a respeito da variável X . Duas variáveis são ditas completamente dependentes quando uma pode ser escrita como função monotônica da outra:

$$x = F(y). \quad (2.2)$$

Nesse caso, o conhecimento de uma das variáveis determina completamente o valor de outra. Ou seja $p(x|y) = \delta(x - F(y))$, com $F(\cdot)$ uma função monotônica. Pode-se, dessa maneira, tentar introduzir alguma

¹ Manteremos o foco de nossa atenção em distribuições bivariadas, uma vez que a generalização é imediata.

forma concreta de medir a dependência estatística em um parâmetro que possa ser estimado e usado para caracterizar a dependência entre variáveis de forma mais concreta.

UM PARÂMETRO COMUMENTE USADO para esse fim é a chamada correlação linear²

$$\hat{\rho}_{XY} = \frac{E[XY] - E[X]E[Y]}{\sigma_X\sigma_Y} = \frac{\text{Cov}(X, Y)}{\sigma_X\sigma_Y}. \quad (2.3)$$

A correlação linear $\hat{\rho}$ é um número real no intervalo $[-1, 1]$, simétrica com relação à transposição de X e Y que sempre se anula quando duas variáveis são independentes. É certamente a medida mais popular de dependência utilizada em todo tipo de análise estatística. Entretanto, seria mais preciso dizer que a correlação linear, como a nomenclatura aqui empregada sugere, é apenas uma medida de dependência linear. Há diversas falhas dessa medida em capturar a completa dependência entre duas variáveis. Em particular é fácil notar que é possível obter duas variáveis com correlação linear nula em que, entretanto, haja forte dependência entre ambas. Um exemplo simples é o par de variáveis definido por:

$$Y = f(X) + \epsilon \quad (2.4)$$

em que X e ϵ sejam independentes e tenham distribuições simétricas em torno da origem e $f(\cdot)$ seja qualquer função par. Nesse caso temos:

$$\text{Cov}(X, Y) = E[Xf(X)] + E[X]E[\epsilon] - E[X]E[f(X)]$$

Note que se a distribuição de X é uma função par, então o valor esperado de qualquer função ímpar de X é nulo, o que anula a expressão acima. Dessa forma temos $\hat{\rho}_{XY} = 0$. Entretanto, caso a distribuição de ϵ seja bastante concentrada em torno da origem, o conhecimento de X pode fornecer informação quase completa a respeito de Y . Essa informação não é capturada pela correlação linear. O epíteto “linear”, usado nesse trabalho para descrever a correlação, pode ser melhor compreendido se notarmos uma propriedade interessante da correlação: ela é invariante por mudanças de escala lineares nas variáveis X e Y . Uma reparametrização do tipo:

$$X' = \alpha_X X + \beta_X$$

$$Y' = \alpha_Y Y + \beta_Y$$

não muda o valor da correlação linear: $\hat{\rho}_{X'Y'} = \hat{\rho}_{XY}$. Entretanto uma mudança mais geral de escala não preserva essa propriedade. Uma nova variável:

$$Y' = g(Y)$$

² A rigor, o módulo da correlação linear. A correlação linear mede, além de dependência, concordância, ou seja, quanto duas variáveis reais apresentam variação coordenada de seus sinais. Essa informação extra não é captada apenas pelo conceito de dependência.

com $g(\cdot)$ monotônica, a princípio contém exatamente a mesma informação a respeito de X que a antiga variável Y . Entretanto não se garante que a correlação se mantenha invariante. Seria esperado, além disso, que a afirmação de que a correlação entre duas variáveis é máxima em módulo fosse uma indicação de que a dependência entre as duas variáveis é máxima. Entretanto, isso não é garantido.

[2.1.1] O QUE SE DESEJA DE UMA MEDIDA DE DEPENDÊNCIA?

A DIGRESSÃO ACIMA acerca da natureza da correlação linear imediatamente suscita a pergunta: que parâmetros são boas medidas de dependência e quais são suas características? Pode-se enumerar uma série de desejos a respeito dessas medidas que se baseiem na noção intuitiva de dependência como o conteúdo de informação de uma variável a respeito de outra. Explicitamente, esperamos que:

1. uma boa medida de dependência seja um funcional $R : P_2 \rightarrow \mathbb{R}$ da distribuição conjunta de probabilidades, bem definido para qualquer par de variáveis aleatórias X e Y ;
2. o funcional seja invariante sob permutação das variáveis X e Y : $R(X, Y) = R(Y, X)$;
3. o funcional seja nulo *se, e somente se* as variáveis forem estritamente independentes;
4. o funcional atinja um valor máximo *se, e somente se* as variáveis apresentem dependência máxima, ou seja, sejam funções monotônicas uma da outra;
5. o funcional seja invariante por escolhas de novas variáveis $(X, Y) \rightarrow (U = u(X), V = v(Y))$ desde que nenhuma informação seja perdida, ou seja, desde que $u(\cdot)$ e $v(\cdot)$ sejam funções bijetoras;
6. o funcional seja uma função monotônica e crescente do módulo da correlação linear para o caso de distribuições conjuntas gaussianas.

Essa série de requisitos, essencialmente³ enumerados pela primeira vez⁴ por Rényi [1], não são suficientes para escolher um parâmetro único e são satisfeitos por uma grande variedade de diferentes parâmetros usados em estatística. Como exemplo podemos citar o τ de Kendall. Dados dois pares, (X_1, Y_1) e (X_2, Y_2) , de pontos sorteados independentemente da distribuição $p_{XY}(x, y)$, o τ de Kendall é dado por:

$$\begin{aligned}\tau_{XY} &= \text{Prob} \{ (X_1 - X_2)(Y_1 - Y_2) > 0 \} - \text{Prob} \{ (X_1 - X_2)(Y_1 - Y_2) < 0 \} \\ &= 4 \int F(x, y) dF(x, y) - 1,\end{aligned}$$

³ Rényi exigia ainda que a medida tomasse valores no conjunto $[0, 1]$, o que dispensamos, uma vez que é sempre possível transpor uma medida no intervalo $[0, \infty]$ para esse conjunto através de uma função monotônica. Além disso há requisitos de continuidade e convergência para sequências convergentes de distribuições.

⁴ A. Rényi. On measures of dependence. *Acta. Math. Acad. Sci. Hungar.*, 10:441–451, 1959; and B. Schweizer and E. F. Wolff. On nonparametric measures of dependence for random variables. *The Annals of Statistics*, 9(4):879 – 885, 1981

onde $F(x, y)$ é a distribuição cumulativa de X e Y . Outra medida que satisfaz esses requisitos é a correlação de postos de Spearman dada por:

$$\rho_{XY}^S = 12 \int (F(x, y) - F_X(x)F_Y(y)) dF_X(x)dF_Y(y), \quad (2.5)$$

onde $F_X(x)$ e $F_Y(y)$ são as distribuições cumulativas marginais de X e Y respectivamente.

[2.2] INFORMAÇÃO MÚTUA

DO PONTO DE VISTA DE TEORIA DE INFORMAÇÃO a dependência mútua de um conjunto de variáveis pode ser quantificada através da mínima “distância na variedade estatística” (divergência de Kullback-Leibler) entre a distribuição conjunta dessas variáveis e a “sub-variedade” de distribuições independentes (veja figura 2.1) Isso pode ser escrito da forma:

$$I(X_1, \dots, X_n) = \min_{\{\phi_i(x_i)\}} \int p(x_1, \dots, x_n) \log \frac{p(x_1, \dots, x_n)}{\prod_{i=1}^n \phi_i(x_i)} \prod_{i=1}^n dx_i \quad (2.6)$$

Fazendo a derivada funcional da expressão a ser minimizada com relação às distribuições indeterminadas $\phi_k(x)$ obtemos a condição de extremo, com o vínculo de que as distribuições $\phi_j(x)$ sejam normalizadas:

$$\phi_k(x_k) = \int p(x_1, x_2, \dots, x_n) \prod_{i \neq k} dx_i = p_{X_k}(x_k) \quad (2.7)$$

Ou seja: a distribuição $\phi_j(x_j)$ devem ser a distribuição marginal da variável X_j , e podemos reescrever:

$$I(X_1, \dots, X_n) = \int p(x_1, \dots, x_n) \log \frac{p(x_1, \dots, x_n)}{\prod_{i=1}^n p_{X_i}(x_i)} \prod_{i=1}^n dx_i \quad (2.8)$$

Esse funcional que mede a dependência mútua entre grupos de variáveis é denominado Informação Mútua ou Correlação Total⁵. Interpretações para a o funcional podem ser obtidas notando que:

$$I(X_1, \dots, X_n) = \sum_{i=1}^n H(X_i) - H(X_1, \dots, X_n) \quad (2.9)$$

$$= H(X_j) - H(X_j | X_1, \dots, X_{j-1}, X_{j+1}, \dots, X_n) \quad (2.10)$$

Dessa forma, pode-se interpretar $I(X_1, \dots, X_n)$ como a redução na incerteza a respeito da variável X_j proporcionada pelo conhecimento das variáveis $X_1, \dots, X_{j-1}, X_{j+1}, \dots, X_n$. A informação mútua para duas variáveis, dada por:

$$I(X, Y) = \int dx dy p(x, y) \log \frac{p(x, y)}{p_X(x)p_Y(y)}, \quad (2.11)$$

⁵ Alguns autores reservam o nome Informação Mútua para o caso de duas variáveis

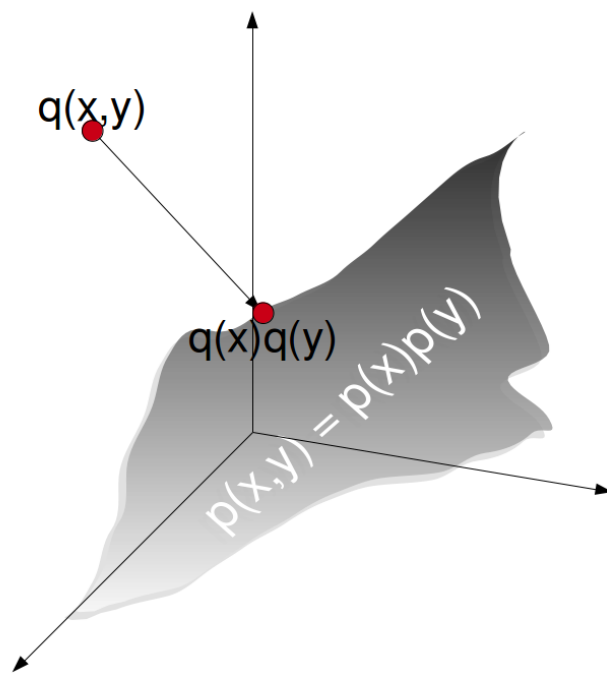


Figura 2.1 – Representação pictórica da projeção de uma distribuição em uma certa família de distribuições convenientes. O espaço representado na figura corresponde de forma pictórica ao espaço formado por todas as distribuições de probabilidade. A superfície corresponde a um sub-espaço, nesse caso, o sub-espaço de distribuições fatoráveis, correspondentes a variáveis independentes. A projeção de uma distribuição qualquer $q(x,y)$ sobre esse sub-espaço através da minimização da divergência de Kullback-Leibler resulta na distribuição dada pelo produto das distribuições marginais $q(x)q(y)$.

satisfaz todos os critérios discutidos na seção anterior para ser uma boa medida de dependência.

[2.3] CÓPULAS

A ELUCIDAÇÃO DO CONCEITO DE DEPENDÊNCIA eventualmente se choca com a noção de cópula⁶. Um teorema devido a Sklar⁷ permite separar a distribuição cumulativa conjunta - $F_{X,Y}(x,y)$ - de duas variáveis em duas partes: (a) as distribuições cumulativas marginais de cada variável - $F_X(x)$ e $F_Y(y)$, que trazem informação idiossincrática a respeito de cada uma das variáveis (b) e uma função cópula $C(u,v)$, que traz informação sobre a dependência entre as variáveis. De maneira geral o teorema de Sklar pode ser enunciado da seguinte forma:

Teorema 4 (Teorema de Sklar). *Para toda distribuição cumulativa conjunta contínua de duas variáveis $F_{X,Y}(x,y)$, com distribuições cumulativas $F_X(x)$ e $F_Y(y)$, existe uma função cópula única $C(u,v)$ tal que:*

$$F_{X,Y}(x,y) = C(F_X(x), F_Y(y)). \quad (2.12)$$

Similarmente, dadas quaisquer duas distribuições cumulativas univariadas $F_X(x)$ e $F_Y(y)$ e uma função cópula $C(u,v)$, é possível construir uma distribuição conjunta dada por $F_{X,Y}(x,y) = C(F_X(x), F_Y(y))$.

A PRÓPRIA FUNÇÃO CÓPULA é uma legítima distribuição cumulativa conjunta, associada às variáveis $U = F_X(X)$ e $V = F_Y(Y)$:

$$F_{UV}(u,v) = C(u,v)$$

Dessa forma, podemos também definir a densidade de cópula, a densidade de probabilidade das variáveis U e V :

$$p_{UV}(u,v) = c(u,v) = \frac{\partial^2 C}{\partial u \partial v}$$

Essa definição implica que a densidade de probabilidade conjunta das variáveis X e Y é dada por:

$$p_{X,Y}(x,y) = c(F_X(x), F_Y(y)) p_X(x) p_Y(y) \quad (2.13)$$

Dessa forma, o teorema de Sklar permite dividir a informação contida na distribuição conjunta em duas partes:

- uma parte que diz respeito apenas às propriedades de cada uma das variáveis – que é dada pelas distribuições marginais;
- e uma parte que diz respeito à dependência estatística entre as duas variáveis – que é dada pela função cópula.

⁶ R.B. Nelsen. *An Introduction to Copulas*. Springer Series in Statistics. Springer, 2006. ISBN 9780387286594. URL <http://books.google.com.br/books?id=B30NT5rBv0wC>

⁷ A. Sklar. Fonctions de répartition à n dimensions et leurs marges. *Publ. Inst. Statist. Univ. Paris*, 8:229–231, 1959

[2.3.1] EXEMPLOS

COMO EXEMPLOS DE FUNÇÕES CÓPULA temos as cópulas associadas às distribuições multivariadas mais comumente utilizadas. Qualquer família de distribuições multivariadas com um conjunto de parâmetros θ dada por $p(x, y|\theta)$ define uma função cópula dada por:

$$C(u, v|\theta) = \int_{-\infty}^{F_X^{-1}(u)} \int_{-\infty}^{F_X^{-1}(v)} dx dy p(x, y|\theta) \quad (2.14)$$

A cópula mais comumente empregada em todo tipo de análise estatística é a cópula normal ou gaussiana que, argumentaremos mais adiante, postula a mínima dependência linear entre duas variáveis:

$$N_\rho(u, v) = \frac{1}{2\pi\sqrt{1-\rho^2}} \int_{-\infty}^{\Phi^{-1}(u)} \int_{-\infty}^{\Phi^{-1}(v)} du dv e^{-\frac{u^2+v^2-2uv\rho}{2(1-\rho^2)}} \quad (2.15)$$

onde $\Phi(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int_{-\infty}^x \exp -u^2/2 du$ é a distribuição cumulativa normal padronizada. A família de cópulas normais depende apenas de um parâmetro $\rho \in [-1, 1]$ que, *no caso em que sejam inseridas marginais gaussianas para formar uma distribuição conjunta*, é igual à correlação entre as variáveis assim distribuídas. É importante notar que, para quaisquer outras marginais, a correlação poderá uma função do parâmetro ρ e de quaisquer outros parâmetros dessas distribuições marginais. Essa família contém a cópula de variáveis independentes $C(u, v) = uv$ quando $\rho = 0$.

UMA CÓPULA LIGEIRAMENTE MAIS COMPLICADA QUE A NORMAL é a cópula associada à distribuição t de Student que, além da dependência linear descrita pelo parâmetro ρ , apresenta também dependência nas caudas da distribuição. A distribuição t de Student bivariada padrão⁸ é dada por:

$$p_T(x, y | \rho, \nu) = \frac{\Gamma(1 + \frac{\nu}{2})}{\Gamma(\frac{\nu}{2})\pi\nu\sqrt{1-\rho^2}} \left[1 + \frac{q_\rho(x, y)}{\nu} \right]^{-(1+\frac{\nu}{2})}, \quad (2.16)$$

onde $q_\rho(x, y) = \frac{1}{1-\rho^2} [x^2 + y^2 - 2\rho xy]$. As marginais dessa distribuição são distribuições t univariadas:

$$p(x_i|\nu) = \frac{\Gamma(\frac{\nu+1}{2})}{\sqrt{\nu\pi}\Gamma(\frac{\nu}{2})} \left(1 + \frac{x_i^2}{\nu} \right)^{-(\frac{\nu+1}{2})} \quad (2.17)$$

No limite $\nu \rightarrow \infty$ essa distribuição se reduz à distribuição normal bivariada padronizada, com parâmetro de correlação linear ρ , médias nulas e variâncias unitárias. Para ν finito as marginais adquirem caudas pesadas e a dependência entre as variáveis ganham uma componente

⁸ Médias não-nulas e variância diferente da unitária podem ser trivialmente acrescentadas através de translações e mudanças de escala. Uma vez que essas transformações só afetam as marginais e mantêm a cópula invariante - são transformações inversíveis, coordenada a coordenada - não afetam a dependência

além da correlação linear - adicionando peso nas caudas da cópula. A cópula t pode ser obtida introduzindo essa distribuição na eq. (2.14):

$$C_T(u, v | \nu, \rho) = \frac{\Gamma(1 + \frac{\nu}{2})}{\Gamma(\frac{\nu}{2})\pi\nu\sqrt{1-\rho^2}} \int_{-\infty}^{t_\nu^{-1}(u)} \int_{-\infty}^{t_\nu^{-1}(v)} dx dy \left[1 + \frac{q_\rho(x, y)}{\nu} \right]^{-\frac{\nu+2}{2}} \quad (2.18)$$

onde $t_\nu(x)$ é a distribuição cumulativa associada à distribuição univariada em (2.17).

UMA TERCEIRA FAMÍLIA DE CÓPULAS que convém citar são as cópulas arquimedianas, que podem ser escritas como:

$$C(u, v | \Psi(\cdot)) = \Psi^{-1}(\Psi(u) + \Psi(v)) \quad (2.19)$$

parametrizadas por uma função ϕ . Essas funções cópula existem desde que: $\Psi(1) = 0$, $\lim_{x \rightarrow 0} \Psi(x) = \infty$, $\Psi'(x) < 0$ e $\Psi''(x) > 0$. Essa família contém a cópula de variáveis independentes quando $\Psi(x) = -\log(x)$.

[2.3.2] DEPENDÊNCIA EXTREMA - LIMITES DE FRECHET-HOEFFDING

A DEFINIÇÃO DE CÓPULA permite tornar mais preciso o conceito de dependência extrema. As equações (2.1) e (2.13) em conjunto nos permitem concluir que, para duas variáveis independentes:

$$c(u, v) = 1, \quad (2.20)$$

$$C(u, v) = uv, \quad (2.21)$$

Para o caso de dependência completa é possível mostrar que⁹ toda cópula está limitada por duas funções que representam dependência máxima, denominadas limites de Frechet-Hoeffding. Essas funções são:

$$W(u, v) = \max(0, u + v - 1) \quad (2.22)$$

$$M(u, v) = \min(u, v) \quad (2.23)$$

Essas duas funções são elas próprias cópulas e limitam por cima e por baixo todas as outras cópulas possíveis:

$$W(u, v) \leq C(u, v) \leq M(u, v) \quad (2.24)$$

para qualquer possível cópula $C(u, v)$. As densidades de cópula associadas a essas duas funções evidenciam que casos descrevem:

$$w(u, v) = \delta(u + v) \quad (2.25)$$

$$m(u, v) = \delta(u - v). \quad (2.26)$$

Inserindo marginais $F(x)$ e $G(y)$ quaisquer, nota-se o tipo de distribuições conjuntas que essas cópulas geram: ambas descrevem duas variáveis com dependência monotônica - crescente no caso de M e decrescente no caso de W .

⁹ R.B. Nelsen. *An Introduction to Copulas*. Springer Series in Statistics. Springer, 2006. ISBN 9780387286594. URL <http://books.google.com.br/books?id=B30NT5rBv0wC>

[2.3.3] MEDIDAS DE DEPENDÊNCIA REVISITADAS

Os “AXIOMAS” DE RÉNYI a respeito de medidas de dependência podem ser revisitados e tornados mais precisos com o conceito de cópula e cópulas extremas em mãos. Os itens 1, 2 e 5 ficam imediatamente satisfeitos se a medida de dependência em questão for funcional apenas da cópula e não das distribuições marginais. Além disso, os itens 3 e 4 podem ser reescritos em termos das cópulas extremas e da cópula independente. Podemos reescrever então esses requisitos da seguinte forma:

- Uma boa medida de dependência entre duas variáveis X e Y é um funcional $\mathcal{F} : C_2 \rightarrow \mathcal{R}$ que leva funções cópula $C_{XY}(\cdot, \cdot)$ em números reais e independe das distribuições marginais;
- atinge um valor mínimo, que será arbitrariamente escolhido como zero, se, e somente se, $C_{XY}(u, v) = uv$;
- atinge um valor máximo quando $C_{XY}(u, v) = W(u, v)$ ou $C_{XY}(u, v) = M(u, v)$.
- para $C_{XY}(u, v) = N_\rho(u, v)$, o funcional é um função monotônica crescente do parâmetro ρ .

A correlação linear falha em dois itens: é possível representar a correlação linear como função da cópula, mas não é possível eliminar sua dependência com as marginais:

$$\hat{\rho}_{X,Y} = \frac{1}{\sigma_X \sigma_Y} \int \int C(u, v) dF_X^{-1}(u) dF_Y^{-1}(v).$$

Essa expressão depende das marginais explicitamente nas medidas de integração e implicitamente nas variâncias σ_i . Além disso, a correlação não atinge seus valor extremo sempre que a cópula escolhida como uma das cópulas de Frechet-Hoeffding - o valor assumido nesse caso depende das marginais específicas. Outras medidas apresentadas acima, o tau de Kendall (τ) e a correlação de postos de Spearman (ρ^S) podem ser facilmente escritas de forma a satisfazer todas os critérios acima:

$$\tau = 4 \int_0^1 \int_0^1 C(u, v) dC(u, v) - 1 \quad (2.27)$$

$$\rho^S = 12 \int_0^1 \int_0^1 [C(u, v) - uv] dudv \quad (2.28)$$

O último requisito pode ser verificado notando-se que, para o caso de cópulas normais, essas expressões se reduzem a¹⁰:

¹⁰ A expressão para o tau de Kendall vale para toda distribuição elíptica, incluindo a distribuição t de Student

$$\tau = \frac{2}{\pi} \arcsin(\rho), \quad (2.29)$$

$$\rho^S = \frac{6}{\pi} \arcsin\left(\frac{\rho}{2}\right). \quad (2.30)$$

Além disso, a Informação Mútua, como mostraremos na próxima seção, também satisfaz os requisitos acima.

[2.4] ENTROPIA DE CÓPULA

PARA ESCREVER a informação mútua como um funcional da cópula basta recorrer à definição da densidade de cópula e a expressão da distribuição conjunta em termos desta, na eq. (2.13) que reproduzimos abaixo:

$$p_{XY}(x, y) = c(F_X(x), F_Y(y)) p_X(x) p_Y(y).$$

Usando essa expressão na definição de informação mútua eq. (2.11):

$$I(X, Y) = \int dx dy p(x, y) \log \frac{p(x, y)}{p_X(x) p_Y(y)},$$

temos:

$$\begin{aligned} I(X, Y) &= \int p_X(x) dx p_Y(y) dy c(F_X(x), F_Y(y)) \log [c(F_X(x), F_Y(y))] \\ &= \int du dv c(u, v) \log c(u, v) \end{aligned}$$

e portanto:

$$I(X, Y) = \int \int du dv c(u, v) \log c(u, v) = -S[c] \geq 0 \quad (2.31)$$

onde $S[c]$ é a entropia associada à distribuição conjunta $c(u, v)$, daqui por diante denominada *entropia de cópula*¹¹. Esse resultado oferece ainda mais uma interpretação aos múltiplos significados da informação mútua - que ressoa diretamente com a definição de dependência apresentada no início deste capítulo - é o conteúdo de informação associado à dependência entre duas variáveis. A combinação desse resultado com a eq. (2.9) permite escrever¹²:

$$H(X_1, X_2, \dots, X_N) = \sum_{i=1}^N H(X_i) + H_{\text{cop}} \quad (2.32)$$

decompondo então a entropia, o conteúdo informacional da distribuição conjunta, em parcelas devidas às características de cada uma das variáveis e uma parcela correspondente ao acoplamento entre essas variáveis. Eq. (2.31) também oferece um conveniente princípio para encontrar cópulas informacionalmente neutras segundo o princípio de máxima entropia¹³: a cópula menos informativa é a que postula a me-

¹¹ Jian Ma and Zengqi Sun. Mutual information is copula entropy. *Tsinghua Science and Technology*, 16(1):51–54, 2011. ISSN 1007-0214. DOI: 10.1016/S1007-0214(11)70008-6. arXiv:0808.0845; and Rick L. Jenison and Richard A. Reale. The shape of neural dependence. *Neural Computation*, 16:665 – 672, 2004

¹² A expressão acima pode ser imediatamente generalizada para um número arbitrário de variáveis

¹³ E.T. Jaynes and G.L. Bretthorst. *Probability Theory: The Logic of Science*. Cambridge University Press, 2003. ISBN 9780521592710. URL <http://books.google.com.br/books?id=tTN4HuUNXjgC>

nor informação mútua possível entre as variáveis.

O ÚLTIMO PASSO para mostrar que a informação mútua satisfaz todos os critérios para ser uma boa medida de dependência é notar que, no caso de cópulas gaussianas:

$$I(X_1, X_2) = -\frac{1}{2} \log(1 - \rho^2) \quad (2.33)$$

[2.5] “EXCESSO” DE INFORMAÇÃO MÚTUA

[2.5.1] CORRELAÇÃO LINEAR *vs.* PARÂMETRO ρ

A DISTRIBUIÇÃO DE MÁXIMA ENTROPIA que satisfaz vínculos de que correlação, médias, e variâncias de um par de variáveis X e Y assumam certos valores é a distribuição normal. Usando a decomposição da eq. (2.32), temos, uma vez que as entropias das marginais dependem apenas das variâncias e a informação mútua apenas da correlação¹⁴:

$$H(X_1, X_2) = h(\sigma_1) + h(\sigma_2) + \frac{1}{2} \log(1 - \rho^2)$$

onde $h(\sigma)$ é a entropia de uma distribuição normal univariada com variância σ^2 . Se essa é a maior possível entropia dada a correlação e variâncias, e uma vez que a informação mútua independe das variâncias¹⁵, então o valor:

$$I_0(\hat{\rho}) = -\frac{1}{2} \log(1 - \hat{\rho}^2) \quad (2.34)$$

é um limite inferior para a informação mútua de qualquer par de variáveis que tenham correlação $\hat{\rho}$:

$$I_{XY} \geq I_0(\hat{\rho}_{XY}). \quad (2.35)$$

Dessa forma, representando formalmente em um plano I *vs.* $\hat{\rho}$ as possíveis distribuições conjuntas com cópula gaussiana¹⁶, temos a figura 2.2.

NESSA FIGURA temos duas distribuições destacadas. Uma delas possui marginais gaussianas, sendo portanto uma distribuição normal bivariada e deve estar localizada sobre a curva $I_0(\hat{\rho})$, representada pela linha escura tracejada. Para essa distribuição o parâmetro ρ , uma boa medida de dependência se restrito a cópulas gaussianas, é exatamente igual à correlação linear $\hat{\rho}$. Se as marginais forem trocadas por marginais não-gaussianas, a informação mútua, independente das marginais, deve permanecer a mesma. Entretanto a correlação, como argumentado acima, deve mudar com a troca de marginais. Uma vez que

¹⁴ Note a importância de separar conceitualmente o parâmetro correlação, que identifica uma certa distribuição na família de distribuições normais, do funcional são homônimos, o qual estamos chamado de “correlação linear” e que está definido para qualquer distribuição.

¹⁵ Pois independe das marginais.

¹⁶ Essa representação não é única. Está sendo empregada apenas como ilustração. Essas duas grandezas não formam um bom sistema de coordenadas para a variedade de distribuições com cópula gaussiana.

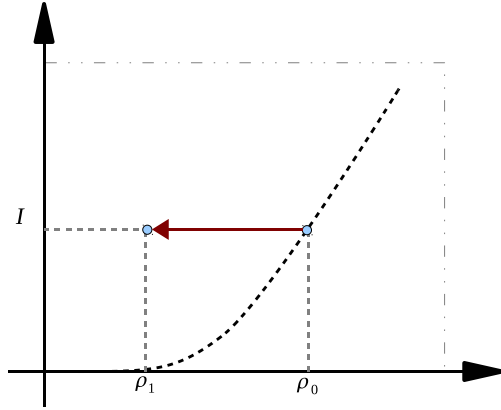


Figura 2.2 – A correlação linear é subestimada no caso de marginais não-Gaussianas. Se ambas as marginais são Gaussianas, a distribuição conjunta está localizada sobre o limite inferior para a informação mútua. Uma mudança nas marginais mantendo fixa a cópula, preserva a informação mútua, entretanto a correlação estimada deve se deslocar para valores de menor módulo.

uma mudança para valores maiores do módulo da correlação linear violaria a condição $I \geq I_0(\hat{\rho})$, a única alternativa é que o módulo da correlação diminua. Dessa forma, teríamos uma distribuição conjunta que tem cópula gaussiana com parâmetro ρ_0 e correlação linear $\hat{\rho} < \rho_0$. Uma tentativa de identificar o parâmetro ρ da cópula gaussiana com a correlação linear levaria a atribuir ao par de variáveis uma dependência menor - talvez muito menor - do que a real. Em muitas aplicações isso pode ser perigoso. Em particular em aplicações financeiras o risco de uma operação pode ser subestimado por se subestimar a frequência de co-ocorrência de eventos negativos. É notório que séries temporais financeiras apresentam distribuições marginais com caudas pesadas - e portanto distantes de uma gaussiana. O uso, bastante difundido¹⁷, de cópulas gaussianas para estimativa de risco combinado com o uso de estimadores baseados na correlação linear nessas condições pode significar que o risco de uma posição é substancialmente maior do que o estimado. Um dos requisitos para uma boa medida de dependência é que, para o caso de cópulas gaussianas, a medida em questão seja função monotônica e crescente do módulo do parâmetro ρ . Dessa forma, qualquer outra medida de dependência é mais adequada que a correlação linear para estimar a dependência de fato entre duas variáveis com dependência gaussiana.

¹⁷S. Jones. The formula that felled Wall St. *The Financial Times*, Abril 2009. URL <http://www.ft.com/cms/s/2/912d85e8-2d75-11de-9eba-00144feabdc0.html>

[2.5.2] INFORMAÇÃO MÚTUA PARA CÓPULAS ELÍPTICAS

O TAU DE KENDALL é um estimador ainda mais completo para ρ : ele é uma função monotônica do parâmetro ρ para qualquer cópula pertencente à família elíptica - da qual a gaussiana é um caso particular. Uma distribuição é dita elíptica sempre que:

$$\langle e^{ik \cdot x} \rangle = e^{i\mu^T k} \psi \left(i \frac{k^T \Sigma k}{2} \right), \quad (2.36)$$

onde Σ é a matriz de covariância e μ o vetor de valores esperados de x . Uma distribuição elíptica padronizada é aquela em que as médias são nulas e todas as variâncias unitárias, de modo que a matriz de covariâncias é igual à matriz de correlações - $\Sigma_{ij} = \rho_{ij}$. Denotaremos essa família de distribuições por $p(x|\Sigma, \psi(\cdot))$. No caso de $\Sigma_{ij} = \delta_{ij}$, a distribuição é invariante por rotações no vetor x e é dita uma *distribuição esférica* - na família $p(x|\psi(\cdot))$.

É POSSÍVEL VER UMA VARIÁVEL DISTRIBUIDA com respeito a uma distribuição elíptica $x \sim p(x|\Sigma, \psi(\cdot))$ como uma transformação linear de variáveis distribuídas com relação à distribuição esférica com o mesma função $\psi(\cdot)$:

$$x_i = \sum_j A_{ij} y_j$$

Onde $\Sigma = A^T A$ e $y \sim p(y|\psi(\cdot))$. Cópulas elípticas são as cópulas associadas a essas distribuições e têm como parâmetros as correlações de pares - ρ_{ij} - e a função $\psi(\cdot)$. A eq.(2.36) é uma transformação de Fourier, que sempre pode ser invertida para obter a distribuição conjunta. No caso de distribuições elípticas padrão, temos:

$$p(x|\Sigma, \psi(\cdot)) = \int \frac{d^N k}{(2\pi)^N} e^{-ik^T x} \psi\left(i \frac{k^T \Sigma k}{2}\right)$$

podemos introduzir uma função delta e obter:

$$p(x|\Sigma, \psi(\cdot)) = \int du \int \frac{d^N k}{(2\pi)^N} e^{-ik^T x} \psi(u) \delta\left(u - i \frac{k^T \Sigma k}{2}\right)$$

e usando a representação integral da função delta:

$$\begin{aligned} p(x|\Sigma, \psi(\cdot)) &= \int \frac{du d\hat{u}}{2\pi} \int \frac{d^N k}{(2\pi)^N} \psi(u) \exp\left[i\hat{u}\left(u - i \frac{k^T \Sigma k}{2}\right) - ik^T x\right] \\ &= \int \frac{du d\hat{u}}{2\pi} e^{i\hat{u}u} \psi(u) \int \frac{d^N k}{(2\pi)^N} \exp\left[\hat{u} \frac{k^T \Sigma k}{2} - ik^T x\right] \end{aligned}$$

A integral gaussiana sobre k pode ser feita e temos:

$$\begin{aligned} p(x|\Sigma, \psi(\cdot)) &= \int \frac{du d\hat{u}}{2\pi} e^{i\hat{u}u} \psi(u) N(x|\hat{u}\Sigma) \\ &= \int du p(u) N(x|u\Sigma) = \end{aligned}$$

onde $N(x|\Sigma)$ é a distribuição normal padronizada com matriz de correlação Σ e $p(u) = \int dv e^{i\hat{u}v} \psi(v)$ é uma certa função ligada à transformada de Fourier de $\psi(u)$. Essa representação para as distribuições elípticas pode ser entendida da seguinte forma: $p(x|\Sigma, \psi(\cdot))$ é a distribuição resultante quando se toma x de uma gaussiana de matriz de correlação $u\Sigma$ em que u é sorteado de acordo com uma distribuição

$p(u)$. Dessa forma podemos, de forma alternativa, parametrizar a família elíptica pela distribuição $p(u) - p(\mathbf{x}|\Sigma, p(\cdot))$. Também podemos escrever de forma mais explícita:

$$p(\mathbf{x}|\Sigma, p(\cdot)) = \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N |\Sigma|}} \int d^N u \frac{1}{u^{N/2}} p(u) e^{-\frac{1}{2u} \mathbf{x}^T \Sigma^{-1} \mathbf{x}} \quad (2.37)$$

$$= \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N |\Sigma|}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \Sigma^{-1} \mathbf{x} \right) \quad (2.38)$$

onde definimos: $\Psi_j(q) = \int d^j u \frac{1}{u^{j/2}} p(u) e^{-\frac{q}{u}}$. As marginais de uma distribuição elíptica podem ser facilmente calculadas notando-se que as marginais da normal padronizada são distribuições normais padronizadas sobre 1 variável. Dessa forma:

$$p_j(x_j) = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \int du \frac{1}{\sqrt{u}} p(u) e^{-\frac{x_j^2}{2u}} = \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \Psi_1 \left(\frac{x_j^2}{2} \right) \quad (2.39)$$

Finalmente de posse dessas das eqs. (2.38) e (2.39) podemos mostrar a seguinte proposição.

Proposição 1 (Decomposição da informação mútua de uma cópula elíptica). *Se $C(u, v|\Sigma, p(\cdot))$ é uma cópula elíptica com matriz de correlação Σ , então a informação mútua associada pode ser decomposta na forma:*

$$I(\Sigma, \psi(\cdot)) = I_0(\Sigma) + I[p(\cdot)], \quad (2.40)$$

onde $I_0(\Sigma) = -\frac{1}{2} \log \Sigma$ é a informação mútua de uma cópula gaussiana com matriz de correlação Σ e $I[p(\cdot)]$ é um funcional de $p(u)$ que é igual à informação mútua da distribuição esférica correspondente e independe da matriz de correlação.

Demonstração. Para mostrar essa proposição recorreremos à eq.(2.9):

$$I = \sum_i^N H[X_j] - H[\mathbf{x}] = NH[X_1] - H[\mathbf{x}]$$

onde a segunda igualdade é obtida notando que as marginais $p_j(\cdot)$ são todas idênticas. A primeira parcela já é um funcional de $p(u)$ que independe da matriz de correlação que pode ser escrito como:

$$\begin{aligned} NH[X_1] &= N \int dx \frac{1}{\sqrt{2\pi}} \Psi_1 \left(\frac{x^2}{2} \right) \log \left[\frac{1}{\sqrt{2\pi}} \Psi_1 \left(\frac{x^2}{2} \right) \right] \\ &= \int d^N x \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \mathbf{x} \right) \log \left[\frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N}} \prod_j \Psi_1 \left(\frac{x_j^2}{2} \right) \right] \end{aligned}$$

A segunda parcela pode ser explicitamente escrita como:

$$H[\mathbf{x}] = - \int d^N x \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N |\Sigma|}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \Sigma^{-1} \mathbf{x} \right) \log \left[\frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N |\Sigma|}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \Sigma^{-1} \mathbf{x} \right) \right]$$

A inversa da matriz de correlação é simétrica e quadrada, e portanto sempre pode ser escrita como $\Sigma^{-1} = U^T \Lambda U$, onde U é uma matriz unitária e $\Lambda_{ij} = \delta_{ij} \lambda_j$ é uma matriz diagonal dos autovalores de Σ^{-1} . Fazendo a mudança de variáveis $\mathbf{y} = U\mathbf{x}$ temos:

$$H[\mathbf{x}] = - \int d^N \mathbf{y} \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N |\Sigma|}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{y}^T \Lambda \mathbf{y} \right) \log \left[\frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N |\Sigma|}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{y}^T \Lambda \mathbf{y} \right) \right]$$

A matriz diagonal Λ pode ser escrita como $\Lambda = D^T D$, onde $D_{ij} = \delta_{ij} \sqrt{\lambda_j}$. Fazendo a mudança de variáveis¹⁸ $\mathbf{x} = D\mathbf{y}$, temos:

$$H[\mathbf{x}] = - \int d^N \mathbf{x} \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \mathbf{x} \right) \log \left[\frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N |\Sigma|}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \mathbf{x} \right) \right]$$

¹⁸ Vamos renomear a nova variável de integração como \mathbf{x} novamente por conveniência

¹⁹ Note que a normalização de $p(\mathbf{x})$ exige que $\int d^N \mathbf{x} \psi_N(\mathbf{x}^T \mathbf{x}) = \sqrt{(2\pi)^N}$

Uma vez que $|D| = \prod_i \sqrt{\lambda_i} = \frac{1}{\sqrt{|\Sigma|}}$. O termo que contém $|\Sigma|$ dentro do logaritmo pode ser removido da integral¹⁹ e ficamos com:

$$H[\mathbf{x}] = - \int d^N \mathbf{x} \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \mathbf{x} \right) \log \left[\frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \mathbf{x} \right) \right] + \frac{1}{2} \log |\Sigma|$$

e finalmente podemos escrever²⁰:

$$I = I[p(u)] - \frac{1}{2} \log |\Sigma| \quad (2.41)$$

onde:

$$I[p(u)] = \int d^N x \frac{1}{\sqrt{(2\pi)^N}} \Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \mathbf{x} \right) \log \left[\frac{\Psi_N \left(-\frac{1}{2} \mathbf{x}^T \mathbf{x} \right)}{\prod_j \Psi_1 \left(\frac{x_j^2}{2} \right)} \right] \quad (2.42)$$

□

ESSA PROPOSIÇÃO nos permite escrever a informação mútua em duas parcelas - uma dependente da estrutura linear de dependência, relacionada à matriz de correlações, e uma parcela que contém informações sobre dependências não-lineares entre as variáveis. Uma vez que a informação mútua é sempre positiva, esse resultado nos permite ainda escrever uma versão mais forte da desigualdade eq.(2.35) para o caso de cópulas elípticas:

$$I_{XY} \geq I_0(\Sigma_{XY}) \quad (2.43)$$

onde, nesse caso, Σ não é apenas a matriz de correlações lineares, mas o conjunto de parâmetros que identifica unicamente uma certa distribuição dentro de uma sub-família de cópulas elípticas com mesma função $\psi(\cdot)$.

[2.5.3] EXCESSO DE INFORMAÇÃO MÚTUA

AS INEQUAÇÕES EQ.(2.35) E EQ.(2.43) permitem concluir que a cópula gaussiana é a cópula de menor entropia dado o vínculo de dependências lineares representados por $\hat{\rho}$ ou Σ . Em outras palavras, a cópula gaussiana é a cópula que assume que uma variável tem a menor quantidade possível de informação a respeito de outra que ainda explica a parte linear da dependência. Além disso, a cópula gaussiana possui apenas a parte linear da informação mútua, e portanto representa uma dependência apenas linear entre as variáveis. O uso dessa cópula portanto representa uma hipótese implícita de dependência linear e mínima entre as variáveis. Caso essa hipótese falhe, um termo adicional deve surgir na informação mútua, que diz respeito à dependência não-linear. Esse termo será chamado “excesso” de informação mútua - entenda-se excesso com relação à cópula linear. A observação de um excesso de informação mútua permite criar um diagnóstico de “gaussianidade” da dependência entre duas variáveis. Para tal é necessário ser capaz de estimar o parâmetro ρ da distribuição e a informação mútua. Para estimar ρ , empregaremos o tau de Kendall -

²⁰ No caso bivariado essa expressão se reduz à expressão 2.34

uma medida que independe das marginais e permite estimar:

$$\rho = \sin\left(\frac{\pi\tau}{2}\right). \quad (2.44)$$

O tau de Kendall pode ser estimado empiricamente com um algoritmo simples: dado um conjunto de pontos $\{x_\mu \sim p(x) | \mu = 1, 2, \dots, P\}$, temos:

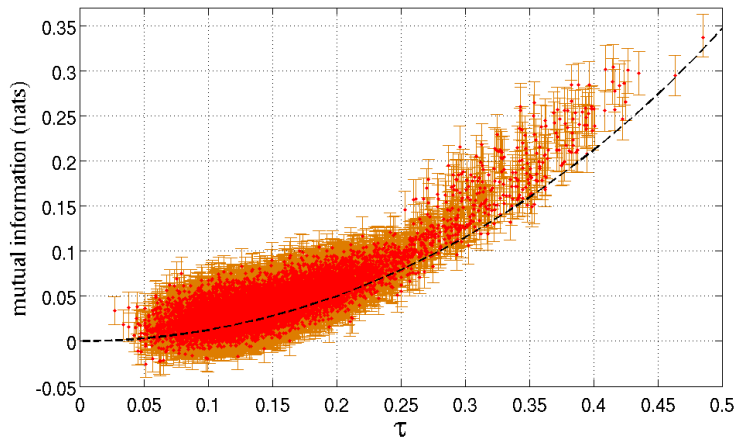
$$\tilde{\tau}[X_i, X_j] = \binom{N}{2}^{-1} \sum_{\mu < \nu} \text{sign}(x_\mu^i - x_\nu^i) \text{sign}(x_\mu^j - x_\nu^j) \quad (2.45)$$

onde a soma é feita sobre todos os pares (μ, ν) . Um método para estimação da informação mútua foi recentemente publicado por Krasnikov et al. [27], baseado em estatísticas de k-vizinhos. Medindo I e τ é possível diagnosticar um eventual “excesso” de informação mútua que, caso presente, indica que a dependência não é mínima e tem uma componente não-linear. Nesses casos a correlação linear não pode ser usada como medida de dependência. Como exemplo desse diagnóstico, mostramos na figura 2.3 estimativas para essas quantidades para séries temporais de uma seleção de 150 das 500 ações que compõe o índice S&P500, um índice de ações de alta capitalização negociadas em bolsas da NYSE Euronext e da NASDAQ OMX definido e mantido pela Standard & Poor’s. As barras de erro para a informação mútua, que representam um intervalo de confiança de 90%, foram calculadas usando o método de bootstrap, repetindo a estimativa do algoritmo KSG²¹ para diversas amostragens com repetição dos dados. O tau de Kendall foi também estimado usando procedimentos padrão como o da eq.(2.45). Observa-se que uma boa quantidade de pontos apresentam, dentro do intervalo de confiança, um valor para informação mútua não compatível com uma cópula gaussiana. Isso sugere que técnicas de avaliação e administração de risco baseadas no uso de cópulas gaussianas podem subestimar de forma substancial a dependência entre duas ações e o grau de co-movimento que elas apresentam. Na figura 2.4 por exemplo, mostramos alguns pares de ações com correlações muito pequenas ($\rho < 0.1$) e que no entanto apresentam informação mútua compatível dependência muito maior do que a capturada por essa medida linear.

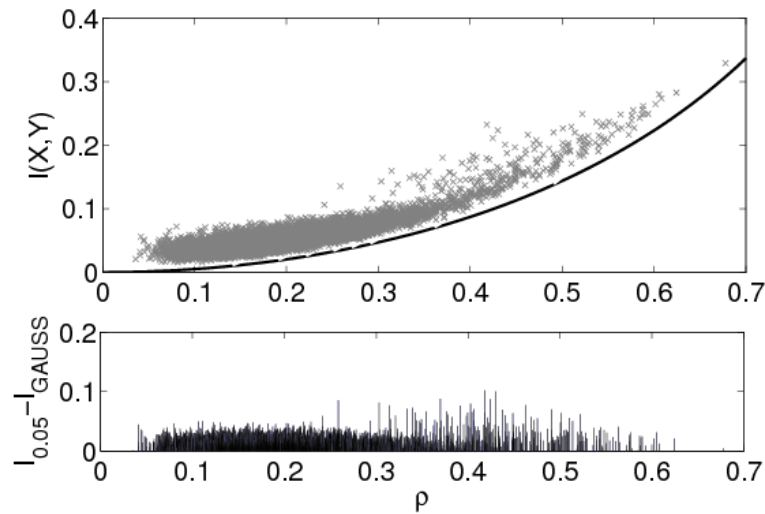
²¹ Alexander Kraskov, Harald Stögbauer, and Peter Grassberger. Estimating mutual information. *Phys. Rev. E*, 69:066138, 2004

[2.5.4] AJUSTE EMPÍRICO DE CÓPULAS VIA INFORMAÇÃO MÚTUA

A DETERMINAÇÃO DE UMA PARTICULAR CÓPULA para realizar essas medidas de risco poderia ser uma alternativa ao uso cego da cópula gaussiana. Uma possível forma de realizar essa determinação é minimizar a divergência de Kullback-Leibler entre a cópula empírica e uma

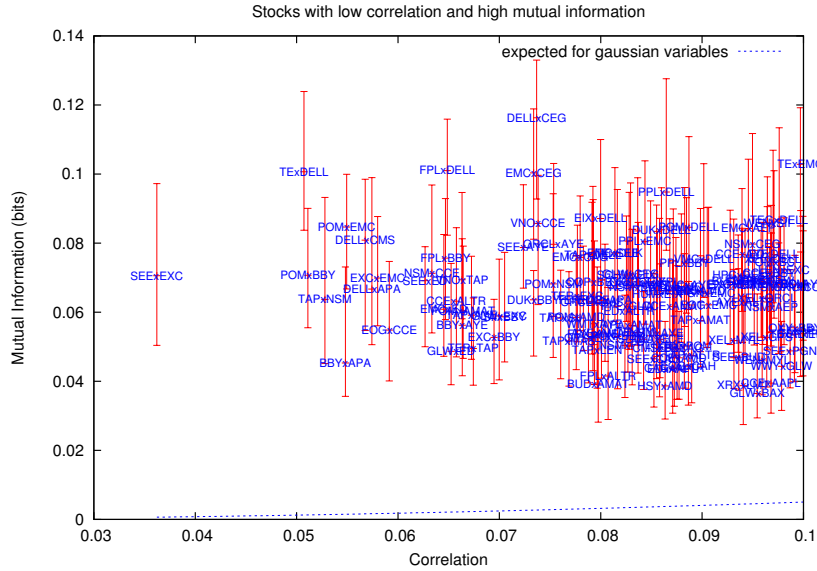


(a) Todos os pares de ações.

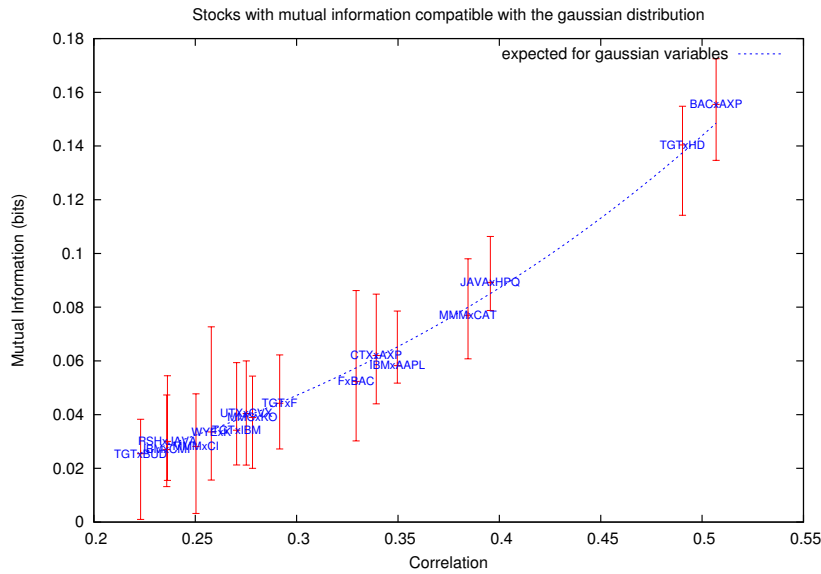


(b) Seleção dos pares cujo limite inferior da barra de erro é maior que a informação mútua gaussiana - excesso de informação não nulo com 90% de confiança (as barras de erro foram removidas para melhor visualização).

Figura 2.3 – Estimativas para a informação mútua usando o algoritmo KSG contra o tau de Kendall (ou correlação medida via tau de Kendall) para pares de séries temporais de log-retornos diários $\log \frac{P_{\text{close}}}{P_{\text{open}}}$ (onde P_{close} e P_{open} são, respectivamente, preços dos ativos na abertura e fechamento diários do mercado) para 150 das ações mais negociadas que compõe o índice S&P500, no período de 02/01/1990 a 16/09/2008 (aproximadamente 4700 pontos por série). As barras de erro representam intervalos de confiança de 90% determinados segundo o procedimento de Bootstrap. Note que, nesse intervalo de confiança, um grande número de pares apresentam um excesso de informação mútua não-nulo com respeito à cópula gaussiana. As linhas tracejadas indicam o limite gaussiano para a informação mútua.



(a) Seleção de pares com baixa correlação e grande excesso de informação mútua



(b) Seleção de pares compatíveis com uma distribuição gaussiana.

Figura 2.4 – Seleção de pares de ações com baixa correlação e grande excesso de informação mútua e pares compatíveis com uma distribuição gaussiana. Modelos de risco baseados em medidas de correlação linear devem ser adequados para o segundo grupo e devem falhar seriamente para o primeiro.

família \mathcal{C}_θ de cópulas parametrizadas por um conjunto de parâmetros θ :

$$D[C(\mathbf{u})||C(\mathbf{u}|\theta)] = \int d^N \mathbf{u} \, c(\mathbf{u}) \log \frac{c(\mathbf{u})}{c(\mathbf{u}|\theta)} \quad (2.46)$$

A minimização desse funcional com respeito a θ fornece uma possível cópula $c(\mathbf{u}|\theta^*)$ que é a mais próxima possível da cópula real dentro dessa família. Essa expressão pode ser manipulada da seguinte forma:

$$D[\cdot|\cdot] = \int d^N \mathbf{u} \, c(\mathbf{u}) \log c(\mathbf{u}) - \int d^N \mathbf{u} \, c(\mathbf{u}) \log c(\mathbf{u}|\theta) \quad (2.47)$$

$$= I - L_\infty(\theta) \quad (2.48)$$

onde o primeiro termo é o negativo da entropia de cópula, igual à informação mútua, como mostrado anteriormente, e o segundo termo é o valor assintótico da log-verossimilhança quando o número de amostras é grande:

$$L_N(\theta) = \frac{1}{N} \sum_{\mu=1}^N N \log c(\mathbf{u}_\mu|\theta)$$

Uma vez que $D[\cdot|\cdot] \geq 0$ e $I \geq 0$, então minimizar a divergência de Kullback-Leibler, cujo menor valor possível é nulo, é equivalente a maximizar a log-verossimilhança com a informação mútua como limite. Se a log-verossimilhança fosse conhecida analiticamente isso poderia ser feito de maneira imediata resolvendo a equação:

$$L_\infty(\theta) = I$$

Para um I determinado empiricamente a partir dos dados, numericamente se necessário. Não há garantia alguma, no entanto de que há solução. Apenas haverá solução para essa equação se a própria cópula original fizer parte da família \mathcal{C}_θ . Nesse caso a solução é única. Além disso não é possível conhecer L_∞ analiticamente sem conhecer a cópula e uma aproximação é necessária. Supondo que a família de cópulas \mathcal{C}_θ é suficientemente próxima da cópula original, podemos substituir $c(\mathbf{u})$ pela própria $c(\mathbf{u}|\theta)$ na integral e aproximar $L_\infty(\theta)$ pela informação mútua de $c(\mathbf{u}|\theta)$. Dessa forma ficamos com uma espécie de método de “correspondência de momentos” (moment matching): deve ser escolhida na família \mathcal{C}_θ a cópula que tem mesma informação mútua que a empiricamente obtida:

$$I(\theta) = I.$$

Novamente, não há garantia de solução, e agora nem mesmo da unicidade da solução. Mas a cópula escolhida certamente será capaz de descrever uma estrutura de dependência mais complexa do que a descrita pela cópula gaussiana. Se a família escolhida for um subconjunto da família de cópulas elípticas, o procedimento pode ser ainda melhorado. Parte do conjunto de parâmetros θ corresponde às correlações Σ .

Escrevendo $I(\theta) = I_0(\Sigma) + \Delta I(\theta')$ pode-se já eliminar a parte linear da informação mútua usando o tau de Kendall para calcular Σ e ajustar o excesso de informação mútua ao medido empiricamente.

[2.5.5] CÓPULA t

COMO EXEMPLO DESSE PROCEDIMENTO vamos escolher uma sub-familia das cópulas elípticas, as cópulas t . Essas cópulas, como discutido anteriormente, são as cópulas que se originam da distribuição t de Student. Quando se permite que o parâmetro ν seja contínuo, essa é, em essência, a mesma distribuição obtida pela maximização da chamada entropia de Tsallis, e essa distribuição e sua cópula associada têm recebido certa atenção na literatura de análise financeira por seu bom ajuste empirico a dados de diversas naturezas²². O cálculo do excesso de informação mútua da distribuição t de Student se resume a calcular a eq.(2.42) - a informação mútua da distribuição t de Student esférica:

$$p(\mathbf{t} | \hat{\Sigma}, \nu) = \frac{1}{Z_N(\nu)} \left[1 + \frac{\mathbf{x}^T \mathbf{x}}{\nu} \right]^{-\frac{\nu+N}{2}} \quad (2.49)$$

onde a normalização é dada por²³:

$$Z_N(\nu) = \int d^N x \left[1 + \frac{\mathbf{x}^T \mathbf{x}}{\nu} \right]^{-\frac{\nu+N}{2}} = \frac{B(\frac{\nu}{2}, \frac{N}{2}) \sqrt{(\pi\nu)^N}}{\Gamma(\frac{N}{2})} \quad (2.50)$$

Uma vez que todas as marginais são idênticas²⁴ a informação mútua se reduz a:

$$I(\nu) = NH_1(\nu) - H_N(\nu), \quad (2.51)$$

onde $H_n(\nu)$ é a entropia de uma distribuição de student n -dimensional. Para calcular H_n note que:

$$\begin{aligned} H_n(\nu) &= - \int d^n x \frac{1}{Z_n(\nu)} \left(1 + \frac{\mathbf{x}^T \mathbf{x}}{\nu} \right)^{-\frac{\nu+n}{2}} \left[-\frac{\nu+n}{2} \log \left(1 + \frac{\mathbf{x}^T \mathbf{x}}{\nu} \right) - \log Z_n(\nu) \right] \\ &= \log Z_n(\nu) + \frac{\nu+n}{2Z_n(\nu)} \int d^n x \left(1 + \frac{\mathbf{x}^T \mathbf{x}}{\nu} \right)^{-\frac{\nu+n}{2}} \log \left(1 + \frac{\mathbf{x}^T \mathbf{x}}{\nu} \right) \\ &= \log Z_n(\nu) + \frac{(\nu+n)\Omega_n}{2Z_n(\nu)} \int_0^\infty dr r^{n-1} \left(1 + \frac{r^2}{\nu} \right)^{-\frac{\nu+n}{2}} \log \left(1 + \frac{r^2}{\nu} \right) \\ &= \log Z_n(\nu) + \frac{(\nu+n)\Omega_n \sqrt{\nu^n}}{2Z_n(\nu)} \int_0^\infty du u^{n-1} \left(1 + u^2 \right)^{-\frac{\nu+n}{2}} \log \left(1 + u^2 \right) \\ &= \log Z_n(\nu) + \frac{(\nu+n)\Omega_n \sqrt{\nu^n}}{2Z_n(\nu)} R_n(\nu) \end{aligned}$$

²² Stefano Demarta and Alexander J. McNeil. The t copula and related copulas. *International Statistical Review*, 73(1):111–129, 2005; and Lisa Borland. Option pricing formulas based on a non-gaussian stock price model. *Phys. Rev. Lett.*, 89(9): 098701, Aug 2002. DOI: 10.1103/PhysRevLett.89.098701

²³ $B(a, b)$ é a função beta, dada por:

$$B(a, b) = \int_0^1 t^{a-1} (1-t)^{b-1} dt$$

²⁴ Todas são iguais à distribuição t de Student em uma dimensão com o mesmo parâmetro ν

Onde $\Omega_n = \frac{2\pi^{n/2}}{\Gamma(\frac{n}{2})}$ é a área de uma esfera unitária em n dimensões e

$$R_n(\nu) = \int_0^\infty du u^{n-1} (1+u^2)^{-\frac{\nu+n}{2}} \log(1+u^2).$$

Essa integral pode ser feita com o auxílio de um truque similar ao truque de réplicas comum em mecânica estatística. Se notarmos que $\log(x) = \lim_{r \rightarrow 0} \frac{\partial}{\partial r} x^r$ podemos escrever²⁵:

$$R_n(\nu) = \lim_{r \rightarrow 0} \frac{\partial}{\partial r} B\left(\frac{\nu}{2} - r, \frac{n}{2}\right) = -B\left(\frac{\nu}{2}, \frac{n}{2}\right) \left[\psi\left(\frac{\nu+n}{2}\right) - \psi\left(\frac{\nu}{2}\right) \right]$$

onde $B(x, y) = \frac{\Gamma(x)\Gamma(y)}{\Gamma(x+y)}$ é a função beta e $\psi(x)$ é a função digamma, substituindo esse resultado na expressão original e escrevendo todos os termos explicitamente temos:

$$H_n(\nu) = \log \left[\frac{\sqrt{(\pi\nu)^n} B\left(\frac{\nu}{2}, \frac{n}{2}\right)}{\Gamma\left(\frac{n}{2}\right)} \right] + \frac{\nu+n}{2} \left[\psi\left(\frac{\nu+n}{2}\right) - \psi\left(\frac{\nu}{2}\right) \right] \quad (2.52)$$

Para o caso $n = 1$ isso se reduz a:

$$H_1(\nu) = \log \left[\sqrt{\nu} B\left(\frac{\nu}{2}, \frac{1}{2}\right) \right] + \frac{\nu+1}{2} \left[\psi\left(\frac{\nu+1}{2}\right) - \psi\left(\frac{\nu}{2}\right) \right] \quad (2.53)$$

E a informação mútua $I = NH_1(\nu) - H_N(\nu)$ finalmente pode ser escrita:

$$I = \log \left\{ \frac{\left[B\left(\frac{\nu}{2}, \frac{1}{2}\right) \right]^N \Gamma\left(\frac{N}{2}\right)}{\pi^{\frac{N}{2}} B\left(\frac{\nu}{2}, \frac{N}{2}\right)} \right\} - \frac{\nu(N-1)}{2} \psi\left(\frac{\nu}{2}\right) \\ + \frac{N(\nu+1)}{2} \psi\left(\frac{\nu+1}{2}\right) - \frac{\nu+N}{2} \psi\left(\frac{\nu+N}{2}\right).$$

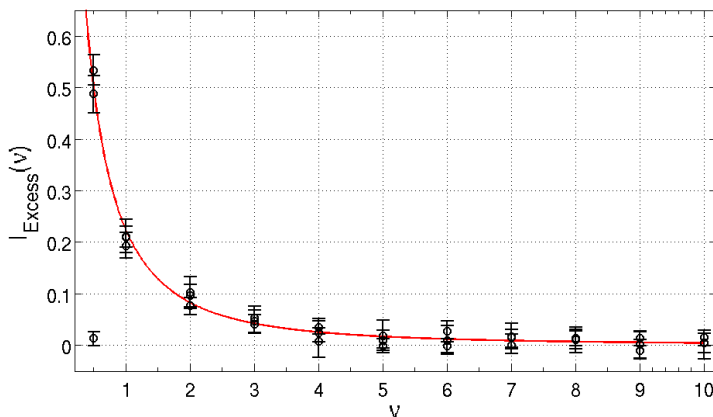
Para $N = 2$ isso se reduz a:

$$I(\nu) = 2 \log \left(\sqrt{\frac{\nu}{2\pi}} B\left(\frac{\nu}{2}, \frac{1}{2}\right) \right) - \frac{2+\nu}{\nu} + (1+\nu) \left[\psi\left(\frac{\nu+1}{2}\right) - \psi\left(\frac{\nu}{2}\right) \right] \quad (2.54)$$

²⁵ Pois:

$$\int_0^\infty du u^{n-1} (1+u^2)^{-\alpha} = B\left(\alpha - \frac{n}{2}, \frac{n}{2}\right), \\ \frac{\partial}{\partial x} B(x, y) = -B(x, y) (\psi(x+y) - \psi(x))$$

Finalmente, a expressão acima pode ser usada, segundo o método discutido na seção 2.5.4, para ajustar cópulas t a dados empíricos. Como ilustração, a figura 2.5 apresenta uma série de simulações de ajuste com dados sorteados de uma cópula t com diversos valores de correlação e ν conhecidos. O excesso de informação mútua é estimado usando o algoritmo KSG²⁶ e o tau de Kendall e plotado em função do ν conhecido. A linha cheia corresponde à eq.(2.54). Esse gráfico mostra que, exceto por um ponto que não pode ser recuperado²⁷, é possível recuperar cópulas t a partir de dados experimentais através desse procedimento.



²⁶ Alexander Kraskov, Harald Stögbauer, and Peter Grassberger. Estimating mutual information. *Phys. Rev. E*, 69:066138, 2004

²⁷ Para um valor muito pequeno de ν , para o qual a distribuição t começa a apresentar diversas patologias, como variância infinita.

Figura 2.5 – Excesso de informação mútua na cópula t . $I(\nu)$, como dado na eq.(2.54). Círculos mostram estimativas para 20 amostragens de pontos de uma cópula t usando o método de “moment matching” para diversos valores de correlação e ν .

[2.6] CONCLUSÕES

A LITERATURA EM TEORIA DE INFORMAÇÃO E TEORIA DE CÓPULAS E DEPENDÊNCIA ESTATÍSTICA - ambas com décadas de existência - se desenvolveram em relativo isolamento, com apenas pontos muito recentes de contato. Neste trabalho tentamos discutir as consequências de alguns desses pontos e conexões entre os dois tópicos. A teoria de cópulas pode ser usada para decompor as distribuições conjuntas em flutuações idiossincráticas das marginais de cada variável e flutuações devidas ao acoplamento entre as variáveis. A conexão com a teoria de informação permite levar adiante essa decomposição e isolar contribuições à informação total contida na distribuição em partes relativas às marginais, ao acoplamento de natureza linear e acoplamentos de mais alta ordem. Essa decomposição oferece testes simples a respeito da linearidade e “gaussianidade” do acoplamento e também sugere um método de ajuste de cópulas baseados no ajuste da informação mútua. Essa abordagem também clarifica os perigos do uso

da correlação linear como medida de dependência em séries financeiras para, por exemplo, estimativas de riscos de contratos complexos e otimização de carteiras, pois essa medida é fadada a subestimar a dependência em séries em que flutuações não-gaussianas são esperadas. Finalmente, pensamos que uma conexão entre essas duas áreas - teoria de informação e teoria de dependência estatística - pode ser útil em fornecer conceitos e técnicas novas para o estudo de sistemas complexos.

[3] UM MODELO PARA EMERGÊNCIA DE AUTORIDADE EM SOCIEDADES HUMANAS.

[3.1] INTRODUÇÃO

OS GRANDES PRIMATAS, em particular os humanos, apresentam vidas sociais intensas. Atividades sociais, formação de coalizões, cooperação para realização de diversas tarefas, guerras, compartilhamento de alimentos, disputas por liderança *et cetera*, situações ubíquas em agrupamentos humanos, não são entretanto limitadas a essa espécie mas são pervasivas em todas as espécies desse grupo[[more sources needed](#)]. Estudos em chimpanzés e bonobos¹[[more sources needed](#)], por exemplo, mostram que a variedade de suas experiências sociais são comparáveis apenas à da espécie humana.

Entretanto a natureza dessa experiência social pode ser bem diferente entre humanos e outras espécies aparentadas. Enquanto a maioria dos grandes primatas vivem em sociedades hierárquicas², marcadas por uma grande concentração dos usos de recursos energéticos e reprodutivos por parte de poucos membros do grupo, os humanos se destacam pela variabilidade de suas experiências sociais nesse espectro³. Certos grupos humanos⁴ apresentam organização fortemente centralizada e hierárquica, com concentração de uso de recursos e riqueza. Outros grupos apresentam sociedades basicamente igualitárias, com compartilhamento de recursos e alimentos, ausência de distinções de status, autoridades ou concentração de riqueza.[[more sources needed](#)] Nossa intenção neste trabalho é investigar, através de um modelo matemático baseado em recentes observações nos campos da arqueologia, primatologia e neurociências, a origem dessa variabilidade.

¹ F. B. M. de Waal. *Chimpanzee Politics: Power and Sex among Apes*. Chimpanzee Politics. Johns Hopkins University Press, 2007. ISBN 9780801886560. URL <http://books.google.com.br/books?id=XsrhU2vV5PIC>

² C Boehm. *Hierarchy in the Forest: The Evolution of Egalitarian Behavior*. Harvard University Press, 2001. ISBN 9780674006911. URL <http://books.google.com.br/books?id=ljxS8gUlgqgC>

³ Sandra L. Vehrencamp. A model for the evolution of despotic versus egalitarian societies. *Animal Behaviour*, 31(3):667 – 682, 1983. ISSN 0003-3472. DOI: 10.1016/S0003-3472(83)80222-X. URL <http://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S000334728380222X>

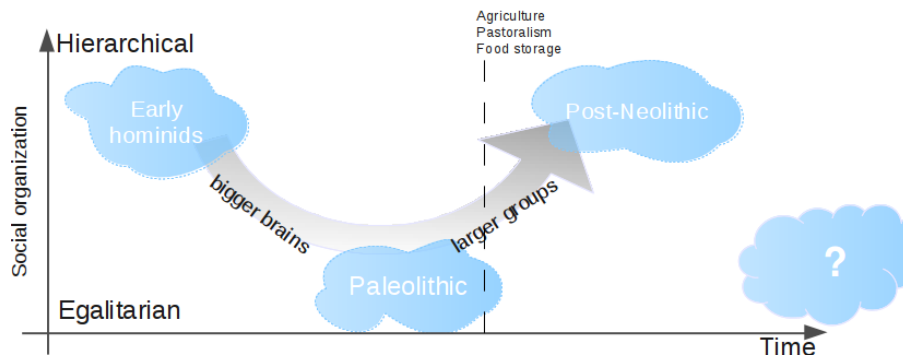
⁴ Dizer aqui que nos preocupamos com a evolução dos humanos e portanto vamos nos fixar em hunter-gatherers e sociedades simples.[[this must be better explained](#)]

[3.2] EVIDÊNCIAS EMPÍRICAS

[3.2.1] “U-SHAPED EVOLUTION”

O REGISTRO ARQUEOLÓGICO REVELA uma dinâmica temporal na organização social dos humanos através da pré-história⁵. Os humanos, descendendo de primatas com provável organização social hierárquica, passaram por um período de grupos igualitários, sem autoridade central, com baixa densidade populacional. No neolítico houve uma transição para grupos fortemente hierárquicos, conforme a densidade populacional aumenta após a revolução agrícola. Esse quadro, ilustrado pela figura 3.1, é denominado em [33] “a U-shaped evolution”.

HOJE, SOCIEDADES HUMANAS preenchem todo o espectro de organização social⁶ e evidências etnográficas também apontam para uma relação entre o tamanho dos grupos de humanos caçadores-coletores e suas formas de organização social⁷. Grupos pequenos de humanos tendem a apresentar organização igualitária, sem concentração de poder. Grupos maiores tendem a apresentar organizações hierárquicas, concentração de poder e hereditariedade de poder.



⁵ Bruce M. Knauff, Thomas S. Abler, Laura Betzig, Christopher Boehm, Robert Knox Dentan, Thomas M. Kiefer, Keith F. Otterbein, Tohn Paddock, and Lars Rodseth. Violence and sociality in human evolution [and comments and replies]. *Current Anthropology*, 32:391–428, 1991. URL <http://www.jstor.org/stable/2743815>; and Joyce Marcus. The archeological evidence for social evolution. *Annu. Rev. Anthropol*, 37:25166, 2008

⁶ Sandra L. Vehrencamp. A model for the evolution of despotic versus egalitarian societies. *Animal Behaviour*, 31(3):667 – 682, 1983. ISSN 0003-3472. DOI: 10.1016/S0003-3472(83)80222-X. URL <http://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S000334728380222X>

⁷ Thomas E. Currie, Simon J. Greenhill, Russell D. Gray, Toshikazu Hasegawa, and Ruth Mace. Rise and fall of political complexity in island south-east asia and the pacific. *Nature*, 467(7317):801–804, Oct. 2010. DOI: 10.1038/nature09461

Figura 3.1 – Ilustração da história da organização social dos humanos e primatas pré-humanos.

[3.2.2] EVOLUÇÃO DO CÉREBRO PRIMATA E A TEORIA MAQUIAVÉLICA

ESTUDOS RECENTES⁸ RELACIONAM o tamanho relativo de regiões do cérebro de diversas espécies de primatas a medidas relacionadas com a capacidade social da espécie, como tamanho dos grupos em que vivem, o tamanho de coalizões, número médio de indivíduos que interagem diretamente, etc. O que é tipicamente encontrado é ilustrado na figura 3.2. Essa figura mostra um gráfico do tamanho médio do

⁸ T Sawaguchi and H Kudo. Neocortical development and social structure in primates. *Primates*, pages 283–90, 1990; Robin Dunbar. Neocortex size as a constraint on group size in primates. *Journal of Human Evolution*, 20:469–93, 1992; R. I. M. Dunbar. Coevolution of neocortical size, group size and language in humans. *Behavioral and Brain Sciences*, 16: 681–694, 11 1993. ISSN 1469-1825. DOI: 10.1017/S0140525X00032325. URL <http://dx.doi.org/10.1017/S0140525X00032325>; Leslie C. Aiello and R. I. M. Dunbar. Neocortex size, group size, and the evolution of language. *Current Anthropology*, 34(2):184–193, 1993; and Tracey H. Joffe and R. I. M. Dunbar. Visual and socio-cognitive information processing in primate brain evolution. *Proceedings of the Royal Society of London. Series B: Biological Sciences*, 264(1386):1303–1307, 1997. DOI: 10.1098/rspb.1997.0180. URL <http://rspb.royalsocietypublishing.org/content/264/1386/1303.abstract>

grupo em função da razão média entre o volume do neocórtex⁹ e o volume total do cérebro para diversas espécies de primatas. O gráfico sugere uma relação do tipo lei de potência entre as duas grandezas, similar a encontradas em diversas outras comparações desse tipo. Em

⁹ O neocórtex é uma região do cérebro envolvida no planejamento, raciocínio espacial, linguagem, entre outras funções cognitivas complexas.

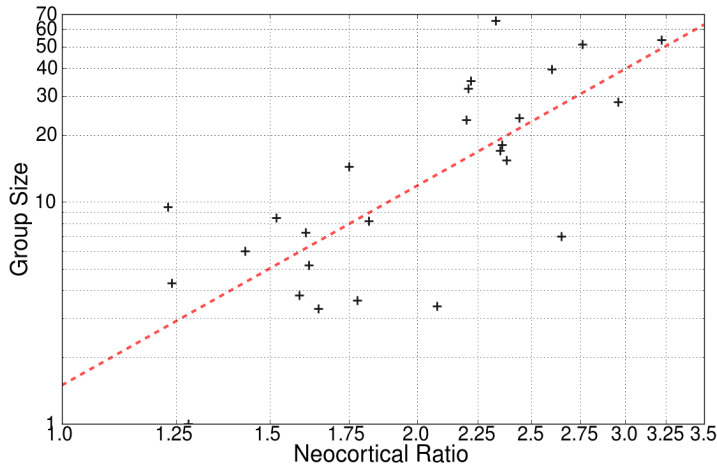


Figura 3.2 – Gráfico em escala logarítmica do tamanho médio do grupo em função da razão média entre o volume do neocórtex e o volume total do cérebro para diversas espécies de primatas. Dados disponíveis em [41].

essência, essa relação sugere que a capacidade cognitiva dos primatas está relacionada à sua necessidade de dar conta de interações sociais complexas. Essa hipótese, denominada Teoria Maquiavélica ou Teoria do Cérebro Social, sugere um cenário em que o rápido crescimento na importância relativa do neocórtex é uma resposta a uma pressão seletiva associada a essa necessidade de interação social. Ambientes sociais complexos favorecem reprodutivamente indivíduos com maior capacidade de processar informações sociais, que, por sua vez, torna as estratégias sociais ainda mais complexas em um “corrida armamentista” evolutiva¹⁰. Essa hipótese tem recebido crescente suporte empírico e aprofundamento teórico¹¹.

¹⁰ R W Byrne and A Whiten. Tactical deception in primates: the 1990 database. *Primate Report, Whole Volume*, 27:1–101, 1990; R W Byrne and A Whiten. Computation and mindreading in primate tactical deception. In A Whiten, editor, *Natural Theories of Mind*. Blackwells, Oxford, 1991; R W Byrne and A Whiten. Cognitive evolution in primates: evidence from tactical deception. *Man*, 27:609–627, 1992; and Andrew Whiten and David Erdal. The human socio-cognitive niche and its evolutionary origins. *Phil. Trans. R. Soc. B*, 367:2119–2129, 2012

¹¹ R. I. M. Dunbar. Cognitive constraints on the structure and dynamics of social networks. *Group Dynamics: Theory, Research, and Practice*, 12(1): 7–16, 2008; R. I. M. Dunbar. The social brain hypothesis and its implications for social evolution. *Annals of human biology*, 36(5):562–72, 2009. DOI: 10.1080/03014460902960289; and Susanne Shultz and Robin Dunbar. Encephalization is not a universal macroevolutionary phenomenon in mammals but is associated with sociality. *Proceedings of the National Academy of Sciences of the United States of America*, 107(50):21582–6, dec 2010. ISSN 1091-6490. DOI: 10.1073/pnas.1005246107. URL <http://www.pubmedcentral.nih.gov/articlerender.fcgi?artid=3003036&tool=pmcentrez&rendertype=abstract>

[3.3] UM MODELO MECÂNICO-ESTATÍSTICO BASEADO EM AGENTES

[3.3.1] DESCRIÇÃO DOS AGENTES

O OBJETIVO DESSA SEÇÃO É descrever um modelo estatístico para a formação de estrutura social que seja tratável por técnicas comuns à mecânica estatística e teoria de informação e compatível com as informações experimentais descritas acima. O primeiro passo na descrição do modelo consiste na elaboração de uma dinâmica de comportamento

para um conjunto de agentes hipotéticos, que será a dinâmica temporal microscópica que dará origem a um modelo mecânico-estatístico.

CONSIDERE UM GRUPO DE n AGENTES dotados de certa capacidade cognitiva limitada e engajados em atividades sociais. Cada agente carrega um registro mental da informação que possui a respeito das relações sociais entre os membros do seu grupo. Essa informação está relacionada a como cada par de outros agentes do grupo se relaciona socialmente. Essa informação deve responder perguntas como:

- qual a possibilidade de esse par de indivíduos serem adversários em uma disputa ou aliados em uma coalizão?
- com que frequência cooperam em uma atividade conjunta?
- como compartilham seus recursos um com o outro?
- etc...

Cada agente adquire essa informação através de mecanismos diversos: através da história social do grupo, baseado no comportamento pregresso dos agentes; através de mecanismos de aprendizado social como fofoca (*gossip*) em que a comunicação com outros agentes permite que o agente aprenda sobre experiências de outros; etc. Uma vez adquirida, essa informação é crítica para subsidiar decisões sociais a serem tomadas pelo agente: com que grupo de agentes fazer uma coalizão, quando esperar cooperação de um certo indivíduo, etc. Erros em decisões podem custar recursos e posição social, e influenciar negativamente a capacidade reprodutiva do agente. Portanto, espera-se que uma espécie de agentes que tenha surgido por evolução via seleção natural tenha mecanismos cognitivos adequados para tentar minimizar esses erros em algum sentido.

A AQUISIÇÃO DESSE TIPO DE INFORMAÇÃO SOCIAL é uma atividade cognitivamente custosa. A capacidade limitada de processar essas informações implica que para mantê-las atualizadas, o indivíduo precisa desviar recursos que poderiam ser aplicados em outras atividades - coleta de alimentos, construção de abrigos, etc. Há evidências ¹² [\[more sources needed\]](#) de que o rastreamento de relações sociais demanda um considerável tempo dos indivíduos adultos em tribos de chimpanzés e humanos. Conforme se aumenta o tamanho do grupo, esse custo cresce com o número de ligações sociais possíveis e, portanto, quadraticamente com o número de indivíduos. Isso pode tornar a estratégia de adquirir e manter informações sobre todas as ligações sociais possíveis no grupo pouco adaptativa. Pode ser preferível ao

¹² F. B. M. de Waal. *Chimpanzee Politics: Power and Sex among Apes*. Chimpanzee Politics. Johns Hopkins University Press, 2007. ISBN 9780801886560. URL <http://books.google.com.br/books?id=XsrhU2vV5PIC>; and F. B. M. de Waal. *Peacemaking Among Primates*. Harvard University Press, 1990. ISBN 9780674659216. URL <http://books.google.com.br/books?id=5at0TN8U6RMC>

agente nesse caso obter apenas informação sobre certas ligações sociais importantes e fiar-se em heurísticas para inferir as outras relações sociais (regras como “amigo do amigo é amigo”, etc...).

DESSA FORMA, O MODELO CONSISTIRÁ dos seguintes elementos: muitos *agentes* que interagem entre si, cada um carregando uma *representação mental da estrutura social* do grupo a que pertence e individualmente tentando *minimizar custos* associados a carregar essas informações sociais. Abaixo discutiremos uma representação matemática de cada um desses elementos.

[3.3.2] VARIÁVEIS DINÂMICAS - GRAFOS SOCIAIS

A REALIZAÇÃO MATEMÁTICA da representação mental da estrutura social que cada agente carrega será feita através de grafos. A cada agente está associado um grafo cujos nós representam todos os indivíduos do grupo e arestas representam as relações sociais sobre as quais o agente possui informação. A informação será considerada binária: o agente pode ter certeza sobre a relação social entre dois indivíduos, havendo portanto uma aresta ligada entre os nós correspondentes de seu grafo, ou não tem nenhuma informação direta sobre ela, caso em que não haverá uma aresta entre os nós correspondentes. As arestas do grafo portanto podem estar apenas ligadas ou desligadas, sem estados intermediários. As arestas do grafo são entidades dinâmicas, que podem ser criadas quando o agente adquire informação sobre uma relação social anteriormente desconhecida, ou destruídas quando o agente, por alguma razão, desiste de continuar mantendo aquela informação. Dados os custos, que serão discutidos abaixo, o agente deverá decidir quais informações valem a pena ser guardadas ou não. Um agente que possui informação completa sobre todas as relações sociais do grupo tem um grafo totalmente conectado, como o representado na figura 3.3.

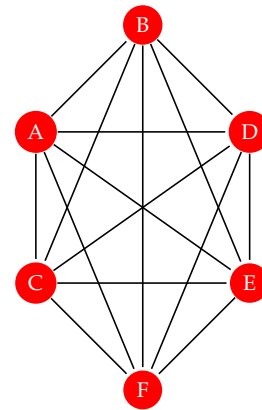


Figura 3.3 – Exemplo de grafo social - um grafo completamente conectado. Um agente com essa estratégia despende recursos para conhecer todas as relações sociais do grupo. Um grafo como esse possui $\frac{1}{2}n(n-1)$ arestas, onde n é o número de agentes.

QUANDO UMA ARESTA É FALTANTE no grafo carregado por um agente, a informação social correspondente à essa aresta é incompleta, e o agente deve recorrer a heurísticas para determinar quaisquer informações necessárias. Para tal, vamos considerar que o grafo deve ser conexo - deve ser possível, para todos os pares de nós, encontrar um *caminho* de arestas ligadas conectando os dois nós. Dessa forma, sempre é possível a um agente determinar alguma informação indireta entre dois nós desconexos, através de uma heurística que utilize as outras arestas conhecidas. Um exemplo é o grafo da figura 3.4, que representa um grafo do tipo estrela.

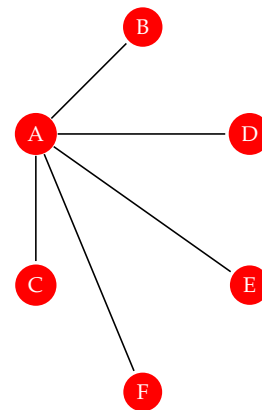


Figura 3.4 – Exemplo de grafo social - um grafo estrela. Um agente com essa estratégia despende recursos para conhecer apenas as relações envolvendo um certo indivíduo central (o nó A na figura). As outras relações são determinadas através de regras heurísticas. Esse grafo possui $n-1$ arestas.

Nesse grafo, não é possível conhecer diretamente todas as relações sociais pois apenas $n - 1$ das $\frac{1}{2}n(n - 1)$ arestas possíveis está presente. Mas todas as relações sociais podem ser indiretamente determinadas por heurísticas sobre caminhos de comprimento 2 (“amigo do amigo é amigo”, etc...). Os grafos mais esparsos possíveis que ainda são conexos possuem $n - 1$ arestas, no mínimo.

[3.3.3] CUSTOS

EM NOSSO MODELO existem custos associados à manutenção de um certo grafo de informações sociais. Há dois tipos de custos:

1. O CUSTO COGNITIVO de adquirir e manter informação dos diferentes pares de indivíduos. Como discutido anteriormente, se o agente tem recursos cognitivos limitados, manter essas informações é custoso. Se assumirmos que o investimento de recursos para obter informações sobre cada aresta do grafo é constante, o custo cognitivo total por agente deverá ser proporcional ao número de arestas do grafo:

$$H_{\text{cognitivo}} \propto n_e \quad (3.1)$$

onde n_e é o número de arestas (*edges*).

2. O CUSTO SOCIAL de falhar em determinar corretamente a relação entre dois indivíduos. As heurísticas utilizadas pelo agente quando ele não possui informação direta sobre uma certa relação social podem falhar e, nesse caso, o agente pode inferir erroneamente a relação social entre dois agentes. Ao tomar decisões baseadas nessa avaliação errônea, o agente incorre em custos - o agente pode avaliar incorretamente em que lado de uma disputa um indivíduo vai se posicionar, falhar em reconhecer uma coalizão em formação, etc, e ter prejuízos reais com uma situação social inesperada. As heurísticas que se valem de relações conhecidas para inferir relações desconhecidas serão tão mais confiáveis quanto menor o caminho a ser percorrido no grafo entre os dois nós em questão. Quanto mais longos os trajetos a serem percorridos, maior é a probabilidade de erro. Portanto, o custo social esperado deve ser proporcional à distância geodésica média entre os nós do grafo:

$$H_{\text{social}} \propto \frac{2}{n(n - 1)} \sum_{i < j} L_{ij} \quad (3.2)$$

onde L_{ij} é a distância geodésica entre os nós i e j , e a soma é realizada sobre todos pares de agentes.

Assim, para cada agente, o custo total de se manter uma certa representação mental da rede social do grupo é dado, portanto, por:

$$H = \frac{n_e}{\alpha} + \bar{L} \quad (3.3)$$

Onde \bar{L} é a distancia geodésica média do grafo, α é uma constante associada à importância relativa entre o custo cognitivo e o custo social (quanto maior α , menos importante é o custo cognitivo). Note que tipicamente n_e escala como uma fração do número total de arestas possíveis $n(n-1)/2$ e que \bar{L} escala tipicamente com $\log(n)$ para grafos aleatórios. É, portanto, interessante, reescrever (3.3), a menos de uma constante multiplicativa, como:

$$H = \phi_e + a\bar{L} \quad (3.4)$$

onde $\phi_e = \frac{n_e}{n(n-1)/2}$ é a fração de arestas ocupadas e $a = \frac{2\alpha}{n(n-1)}$ é uma constante de acoplamento normalizada.

[3.3.4] DINÂMICA PARA AGENTES ISOLADOS - MÁXIMA ENTROPIA

[3.3.5] MINIMIZAÇÃO DO CUSTO

PARA QUE UM MODELO POSSA SER ESTABELECIDO, não basta a expressão para o custo, mas uma descrição de que ações o agente deverá tomar com base em sua aferição do custo. A estratégia do agente é definida por uma certa escolha de arestas a investir. Em uma primeira abordagem, atribuímos ao agente a tendência a usar a estratégia que minimiza o custo total. Então deveríamos procurar pelo grafo definido por:

$$G_*(\alpha) = \arg \min_G H(G, \alpha) \quad (3.5)$$

Se $\alpha \gg 1$, então as limitações cognitivas são menos e menos importantes. O grafo que minimiza o custo é o grafo que minimiza a distância geodésica média - um grafo totalmente conectado como o da figura 3.3. Se $\alpha \ll 1$, então as limitações cognitivas se tornam mais e mais importantes, e o grafo ótimo é aquele que minimiza o número de arestas, enquanto ainda mantendo uma distância média finita - um grafo em forma de estrela ¹³ como o da figura 3.4. Para valores intermediários de α , o grafo ótimo possui configurações intermediárias entre esses dois extremos.

PODEMOS RELAXAR O VÍNCULO DE ESTRITA MINIMIZAÇÃO e propor o seguinte modelo: o agente decide sua estratégia através de uma dinamica interna que ocorre em seu cérebro, ditada por regras que levam em conta o custo total. Podemos então associar probabilidades às estratégias de acordo com nossa expectativa de que grafos devem surgir

¹³ Estritamente para $\alpha = 0$ o grafo ótimo é o grafo sem aresta alguma. Não há prescrição canônica para a distância geodésica média de um grafo sem arestas. Adotaremos aqui a convenção de que se não é possível desenhar um caminho entre dois nós (em outras palavras: dois nós que pertencem a diferentes componentes do grafo), então a distância entre eles é infinita. Isso restringe nossa análise apenas a grafos conexos. Mesmo entre os grafos conexos, a estrela não é o único mínimo do custo acima para α estritamente zero - o grafo caminho também é possível. Entretanto, para o grafo caminho, L é proporcional a N , e portanto, para $\alpha \rightarrow +0$ o único mínimo existente quando $\alpha > 0$ tem grafo estrela como limite.

dessa dinâmica. Se não conhecemos detalhes da dinâmica, mas temos informação de que o valor esperado do custo total é uma variável importante, o procedimento bayesiano adequado é associar ao grafo uma distribuição de máxima entropia, restringida pelo valor do custo total. A distribuição resultante é a distribuição de Gibbs:

$$p(G) = \frac{q(G)}{Z} e^{-\beta H(G)} \quad (3.6)$$

onde β , uma espécie de inverso de temperatura, regula a importância relativa dos efeitos que o custo $H(G)$ e outros efeitos negligenciados pelo modelo, e $q(G)$ é a atribuição de probabilidades a priori. Assumiremos probabilidades uniformes a priori, com a restrição de que o grafo seja conexo (veja nota ¹³). A atribuição de probabilidades da equação (3.6) torna o problema de determinar as propriedades macroscópicas desse sistema em um problema de mecânica estatística, cuja variável dinâmica é a matriz de adjacências do grafo G :

$$M_{ij} = \begin{cases} 1 & \text{se } i \text{ e } j \text{ estão ligados por uma aresta} \\ 0 & \text{outro caso} \end{cases} \quad (3.7)$$

[3.3.6] INTERPRETAÇÃO DOS PARÂMETROS α E β

O parâmetro α (ou sua versão normalizada, a) regula a importância relativa entre os dois custos - social e cognitivo. O valor de α é regulado pela capacidade cognitiva dos agentes: quanto maior a capacidade de realizar cálculos sociais, menor é a importância do custo cognitivo, maior é o valor de α . No presente trabalho α será, portanto, interpretado como uma medida da capacidade cognitiva dos agentes. O parâmetro normalizado a é, portanto, a fração da capacidade cognitiva que deveria ser gasta para aprender todas as relações sociais do grupo.

O parâmetro β regula a escala em que flutuações no valor do custo total são toleradas. Para β grande, variações no custo total acima do custo mínimo são muito pouco prováveis. Para valores maiores de β as mesmas flutuações apresentam probabilidades maiores. Dessa forma, β regula o quão prováveis são configurações que consistem de flutuações em torno das configurações ótimas discutidas na seção *Minimização do custo*. Flutuações em torno do custo mínimo representam um dispêndio extra de energia e recursos que poderiam ser gastos em outras atividades, portanto β pode ser parcialmente entendido como uma variável ecológica - escassez de recursos implica em menor possibilidade de permitir grandes flutuações do custo total. Além disso, pressões de pares pode causar o mesmo tipo de efeito de intolerância a erros de minimização do custo [\[more sources needed\]](#). Assim, β é uma

variável externa, que regula a intensidade da pressão para otimização do custo total, que pode ter origem social ou ecológica.

[3.3.7] RESULTADOS NUMÉRICOS PARA AGENTES ISOLADOS

SIMULAÇÕES DE MONTE CARLO desse modelo foram feitas usando o algoritmo de Metrópolis. Partindo de um grafo inicial aleatório (sorteado do ensemble de Erdos-Rényi, com fração de arestas $\frac{1}{2}$), a cada passo do algoritmo é proposta uma mudança em uma aresta do grafo - adicionando uma aresta faltante ou removendo uma aresta existente. Caso a mudança não quebre a conectividade do grafo, ela será aceita com probabilidade dada pelo fator de Gibbs:

$$e^{-\beta(H(G')-H(G))}. \quad (3.8)$$

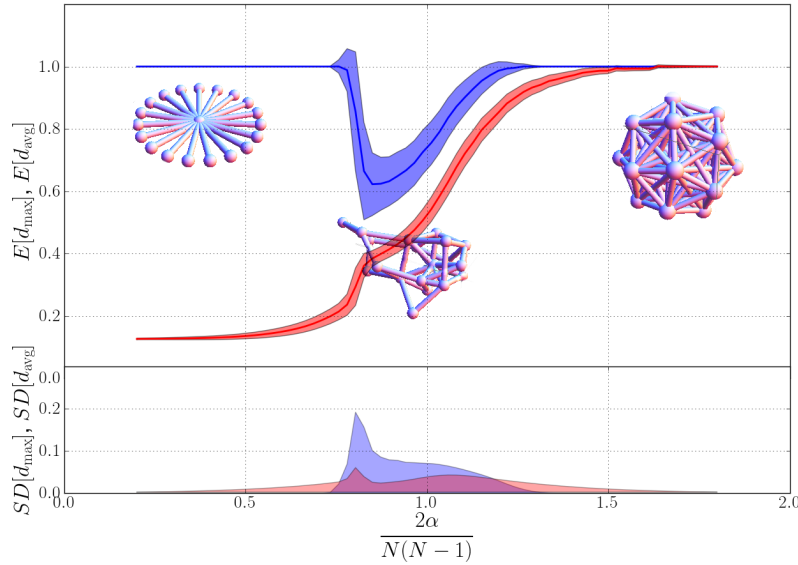


Figura 3.5 – Corte do diagrama de fases apresentando o valor esperado obtido via Monte Carlo dos parâmetros de ordem normalizados d_{\max} e d_{avg} em função de α , com temperatura e número de agentes fixo, bem como seus desvios padrão. Sobreposto ao gráfico se observam exemplos de arquiteturas do grafo sorteadas da distribuição de equilíbrio na região correspondente do diagrama.

NA FIGURA 3.5 temos um corte do diagrama de fase desse modelo com temperatura e número de agentes constante, variando o parâmetro α . Seja d_i o grau do i -ésimo nó do grafo de um agente escolhido ao acaso. No painel superior destacamos dois parâmetros de ordem: $d_{\max} = \frac{1}{N-1} \max(d_1, d_2, \dots, d_N)$, em azul, é proporcional ao grau do nó mais bem conectado do grafo, e $d_{\text{avg}} = \frac{1}{N(N-1)} \sum_{i=1}^N d_i$, em vermelho, é proporcional ao grau médio de todos os nós do grafo. Uma vez que o maior possível grau para um nó é $N-1$, esses parâmetros foram normalizados para que o valor máximo seja 1. As linhas sólidas

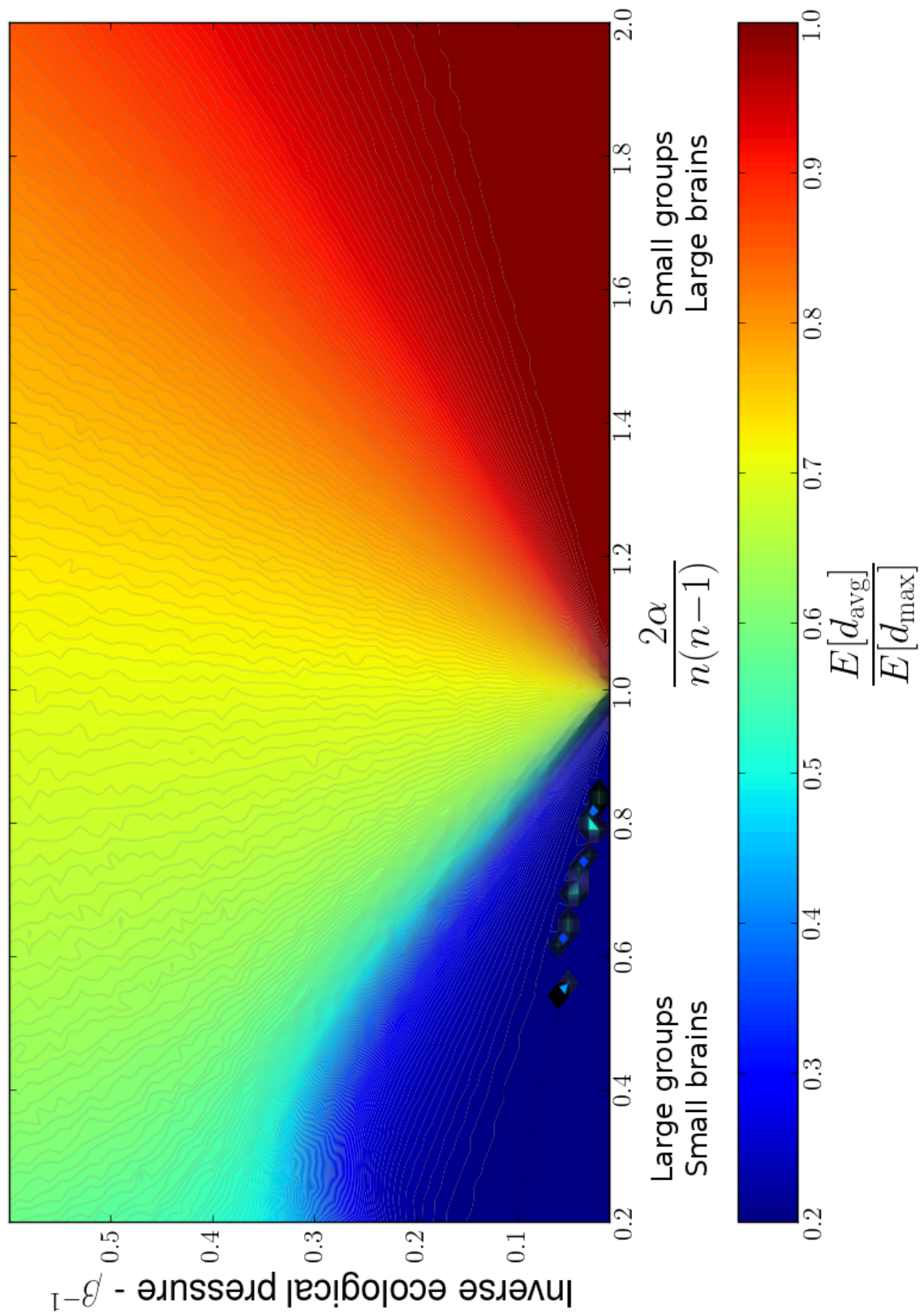


Figura 3.6 – Diagrama de fases apresentando a razão $\frac{d_{\text{avg}}}{d_{\text{max}}}$ em função de α e temperatura, para um número fixo de agentes.

correspondem aos valores esperados:

$$E[d_{\max}] = \sum_G P(G|\alpha, n, \beta) d_{\max}(G) \quad (3.9)$$

$$E[d_{\text{avg}}] = \sum_G P(G|\alpha, n, \beta) d_{\text{avg}}(G) \quad (3.10)$$

obtida através da simulação de Monte Carlo do modelo, enquanto o sombreado ao redor da linha representa o desvio padrão obtido da mesma forma. No painel inferior apresentamos novamente o desvio padrão para melhor visualização. Sobrepostas aos gráficos estão figuras representativas de grafos sorteados da distribuição de equilíbrio em pontos correspondentes do diagrama de fases.

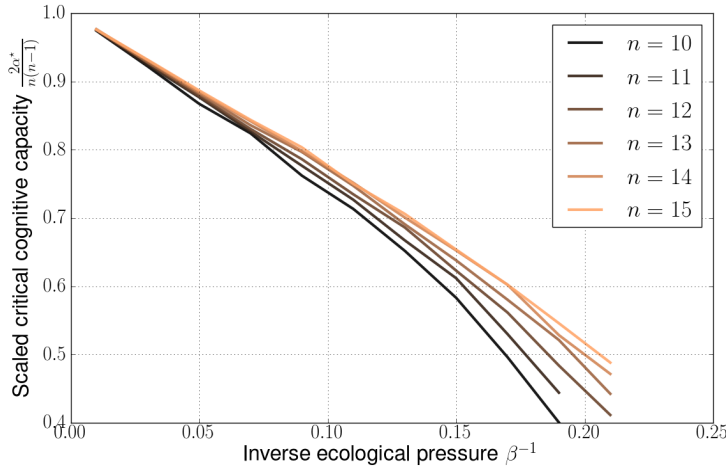


Figura 3.7 – Valor crítico do parâmetro a em função da temperatura para diferentes tamanhos do sistema.

NA FIGURA 3.6 temos um diagrama de fases completo variando α e a temperatura para um número fixo de agentes. A variável descrita no mapa de cores é a razão $\frac{d_{\text{avg}}}{d_{\text{max}}}$. Esse diagrama mostra uma linha de transição de fases entre a região azul escura - a região em que a organização do grafo é fortemente centralizada, com nós periféricos pouco conectados, e uma região em que a razão $\frac{d_{\text{avg}}}{d_{\text{max}}}$ é menos extrema. Acima de uma temperatura crítica essa fase não é mais observada. A região vermelho escura corresponde à fase totalmente conectada, ou situações bem próximas disso. Nessa região não há grandes saltos nos parâmetros de ordem, que mudam continuamente com a temperatura e a . A linha de transição de fase pode ser observada para diferentes valores da temperatura na figura 3.7. Note que para $\beta^{-1} \rightarrow 0$, temos $\alpha^* = 1$.

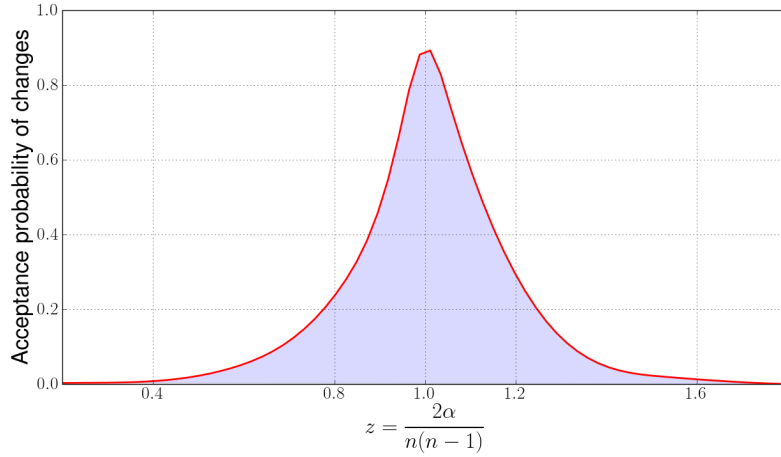


Figura 3.8 – Taxa de aceitação do algoritmo de Monte Carlo - fração das propostas de mudanças no microestado do sistema que foram aceitas com probabilidade dada pelo fator de Gibbs, amostrada com $\beta = 1.0$

[3.3.8] APROXIMAÇÃO DE CAMPO MÉDIO

É POSSÍVEL fazer uma aproximação de campo médio para os resultados numéricos encontrados, no espírito do descrito na seção 1.2.5, *Métodos de campo médio*. A família de distribuições escolhida para tratar esse problema é a ensemble de grafos de Erdős-Rényi¹⁴, $G(n, p)$, que consiste de grafos de n vértices em que cada aresta está presente com probabilidade p . A família de distribuições de probabilidades sobre grafos associada ao ensemble de Erdős-Rényi, parametrizada por p , consiste de distribuições uniformes dentro do conjunto de grafos com mesmo número de vértices n e mesmo número de arestas n_e . A probabilidade de que um grafo sorteado do ensemble de Erdős-Rényi tenha número de arestas n_e é dada por uma distribuição binomial:

$$p(n_e|G(n, p)) = \binom{N_e}{n_e} p^{n_e} (1-p)^{N_e-n_e} \quad (3.11)$$

onde $N_e = n(n-1)/2$ é o número máximo de arestas.

COM A FAMÍLIA DE DISTRIBUIÇÕES ESCOLHIDA, podemos calcular a energia livre aproximativa definida na equação 1.15, dada por:

$$F(p) = E[H(G, \alpha)|G(n, p)] - TS[G(n, p)] \quad (3.12)$$

Onde $T = \frac{1}{\beta}$ é o inverso do parametro β .

A entropia $S[G(n, p)]$ é simplesmente a entropia da distribuição bi-

¹⁴P. Erdős and A. Rényi. On the evolution of random graphs. *Publ. Math. Inst. Hung. Acad. Sci.*, 5:17–61, 1960; and M. E. J. Newman, S. H. Strogatz, and D. J. Watts. Random graphs with arbitrary degree distributions and their applications. *Phys. Rev. E*, 64: 026118, Jul 2001. DOI: 10.1103/PhysRevE.64.026118. URL <http://link.aps.org/doi/10.1103/PhysRevE.64.026118>

nomial 3.11, que para n grande pode ser aproximada por:

$$S[G(n, p)] = \frac{1}{2} \log(2\pi N_e p(1-p)) + O\left(\frac{1}{N_e}\right). \quad (3.13)$$

O valor esperado da energia consiste em duas partes: o valor esperado da fração de arestas ocupadas, que é simplesmente p , e a distância geodésica média do grafo. Uma aproximação para o segundo valor pode ser obtida usando a técnica de funções geratrizes¹⁵ e é dada por¹⁶:

$$E[\bar{L}] = \frac{\log(n-1)}{\log(p) + \log(n-1)} \quad (3.14)$$

Dessa forma, a expressão para a energia livre se torna:

$$F(p) = p + a \frac{\log(n-1)}{\log(p) + \log(n-1)} - \frac{T}{2} \log(2\pi N_e p(1-p)), \quad (3.15)$$

que pode ser facilmente maximizada numericamente para obter os resultados da figura 3.9. *[this must be better explained]* Mais discussão aqui.

¹⁵ Newman et al. [50]

¹⁶ Ver apêndice B

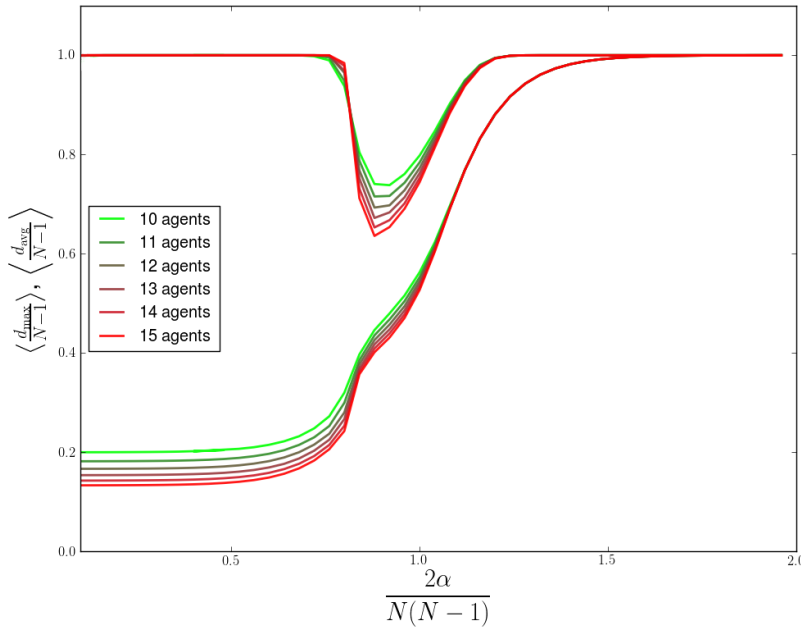


Figura 3.9 – Comparação do resultado de campo médio obtido pela maximização numérica da energia livre 3.15 e do resultado de Monte Carlo. O resultado é blabla.

[3.3.9] INTERPRETAÇÃO PARCIAL DOS RESULTADOS

O diagrama de fases apresenta três regimes. Para valores altos de $a = \frac{2\alpha}{N(N-1)}$, ou seja, alta capacidade cognitiva ou grupos com poucos agentes, todos os nós apresentam praticamente a mesma conectividade. O grafo é simétrico, com conectividade densa e bem próximo

de totalmente conexo. A variação de $E[d_{\max}]$ e $E[d_{\text{avg}}]$ com a nesse regime é compatível com a de um ensemble de Erdős-Rényi com alta conectividade, o que indica que as arestas são mais ou menos aleatoriamente distribuídas, de forma totalmente simétrica.

Para valores intermediários de a , existe um nó com conectividade ligeiramente maior, mas existem flutuações grandes. A taxa de aceitação do algoritmo de monte carlo é alta (ver: figura 3.8). Nesse regime, o grafo é momentaneamente não-simétrico, mas estatisticamente qualquer nó pode ocupar a posição de conectividade maior e alterações desse nó central são frequentes. Há um pico nos desvios padrão dos parâmetros de ordem para um certo valor do parâmetro de controle a^* , indicando um possível ponto crítico.

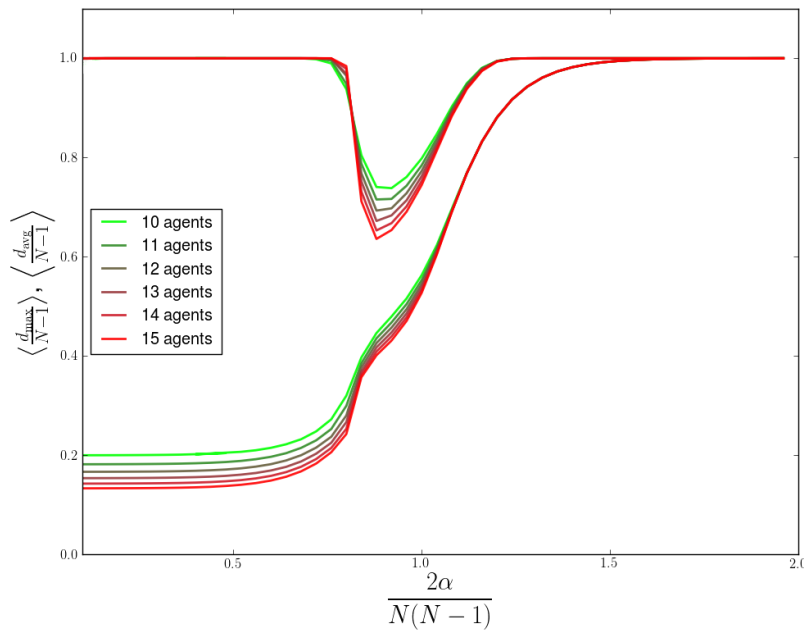


Figura 3.10 – Corte do diagrama de fase para vários tamanhos do grupo.

Para valores mais baixos de a , a simetria é espontaneamente quebrada e apenas um nó ocupa uma posição central. Esse nó está conectado a todos os outros, que estão quase que exclusivamente conectados a ele. O grafo se torna uma estrela e não há flutuação observável na conectividade do nó central. Neste regime, a representação mental da rede de relacionamentos sociais construídas pelo agente é assimétrica e existe um único nó que serve como proxy para todas as relações sociais do grupo. Na representação mental do agente em questão, o status social de cada um dos outros nós é definido por como ele se relaciona a esse nó central.

Na figura 3.10 pode-se ver como o diagrama de fases varia com

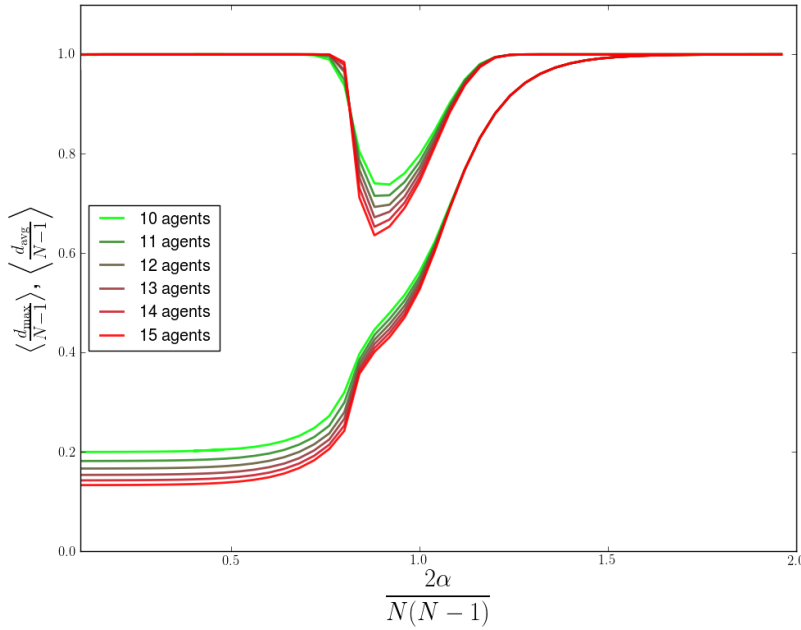


Figura 3.11 – Finite size scaling do modelo.

o número de agentes. Quanto maior o número de agentes, maiores as variações dos parâmetros de ordem durante a possível transição de fase. Na figura 3.11 podemos ver uma simulação com finite size scaling em um gráfico do inverso do desvio padrão de $E[d_{\max}]$ no ponto crítico α^* contra o tamanho do sistema, mostrando que essa grandeza diverge para $N \rightarrow \infty$.

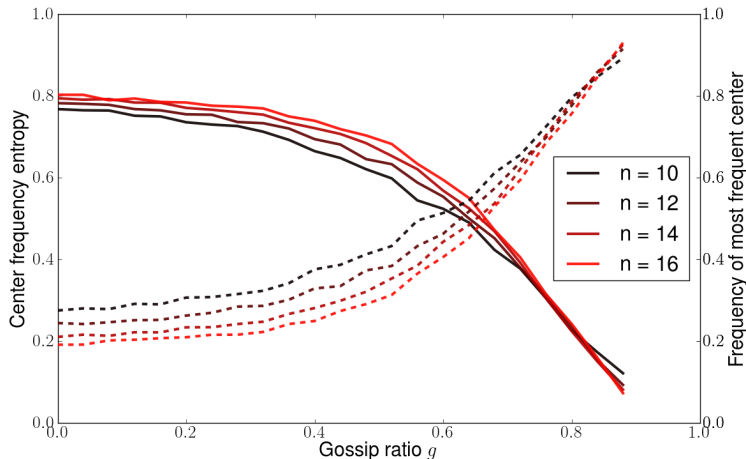
[3.3.10] DINÂMICA PARA MUITOS AGENTES E RESULTADOS NUMÉRICOS

AS FIGURAS ACIMA tratam de propriedades independentes da interação entre os agentes. Essa interação, como dito anteriormente, será introduzidas na forma de aprendizado social (“fofoca” ou *gossip*). Durante a simulação de Monte Carlo, duas possíveis fontes serão consideradas para a proposta de uma nova aresta no passo de Metropolis:

- Com probabilidade $1 - g$, um novo valor para a aresta (i, j) do agente k será sorteado ao acaso,
- Com probabilidade g , um novo valor para a aresta (i, j) do agente k será copiado da aresta (i, j) de um outro agente l sorteado ao acaso.

Essa proposta de novo valor de aresta será aceita com probabilidade proporcional ao fator de Gibbs (3.8). Esse procedimento visa imitar o

aprendizado social observado em humanos ¹⁷. Essa escolha de interação não altera os diagramas de fase já mostrados no capítulo anterior, mas introduz correlação entre os grafos de diferentes agentes.



Na figura 3.12 são exibidas duas grandezas que quantificam a correlação entre os grafos na fase estrela. Vamos denotar por c_i o label que identifica o nó central do grafo do i -ésimo agente. Para um certo número N de agentes temos então o conjunto $\{c_1, c_2, \dots, c_N\}$. Seja a variável aleatória C definida como um valor sorteado ao acaso desse conjunto e seja:

$$p(c) = \text{Prob} \{C = c\}$$

a sua distribuição de probabilidades. O primeiro parâmetro de ordem, correspondente às linhas tracejadas, é dada por $E[\max_c p(c)]$, ou seja, o fração do número de agentes que possuem como nó central o nó que mais vezes aparece como nó central. Isso corresponde de forma grosseira a que fração dos agentes tem grafos estrela com o mesmo nó ocupando o centro da estrela. A segunda variável é, a menos de uma constante multiplicativa, simplesmente a entropia da distribuição de c : $S(c) = -\sum_c p(c) \log p(c)$. Ambas as grandezas são calculadas para grafos em forma de estrela, em função da probabilidade de encontro entre dois agentes dada por g , para valores fixos de temperatura, variando-se o número de agentes. O resultado mostra que, para baixos valores de g , a probabilidade de que um certo nó seja o centro de um agente tomado ao acaso é aproximadamente uniforme, e nenhum dos nós domina como centro de uma fração substancial de grafos. Para valores maiores de g , os grafos estrela tendem a se correlacionar e o mesmo nó pode ser central em uma grande fração de agentes. Dessa forma, é possível que no regime em que o grafo é uma estrela, o mesmo

¹⁷ R. I. M. Dunbar. *How Many Friends Does One Person Need? Dunbar's Number and Other Evolutionary Quirks*. Harvard University Press, 2010. ISBN 9780674057166. URL <http://books.google.com.br/books?id=W-kkeffNx5MC>

Figura 3.12 – Parâmetros de ordem associados à correlação entre grafos de diferentes agentes, calculados na fase em que os grafos apresentam estrutura de estrela. As curvas tracejadas correspondem à frequência do nó central mais frequente. As linhas tracejadas correspondem à entropia da distribuição de centros.

agente sirva como proxy para as relações sociais de todo o grupo para uma substancial maioria dos agentes.

[3.4] SUMARIZAÇÃO E INTERPRETAÇÃO DOS RESULTADOS

Construímos um modelo para a organização social de uma sociedade de agentes que tentam representar mentalmente sua estrutura social. A representação mental tem um custo cognitivo, derivado da limitação cognitiva do agente, e um custo social, derivado da necessidade de se navegar corretamente as relações sociais. Esses custos levam a um modelo mecanico-estatístico que possui um diagrama de fases com alguns regimes interessantes, controlados pelos parâmetros a , que regula a capacidade cognitiva do agente e/ou o tamanho do grupo, g que controla a intensidade da interação social e β , que controla a tolerância a flutuações no custo total do agente. As fases observadas são:

[3.4.1] GRUPOS PEQUENOS E/OU ALTA CAPACIDADE COGNITIVA

Para a grande, ou seja, grupos de tamanho pequeno ou agentes com grande capacidade cognitiva, os agentes possuem modelos mentais do panorama social do seu grupo em que nenhum agente em particular ocupa uma posição central. Em outras palavras, a representação mental das redes sociais nesse grupo são todas simétricas e nenhum agente se destaca. Nessa fase, em que nenhum agente se destaca como referência social para os outros, pode-se invocar a teoria da dominância reversa. Em situações em que a representação mental dos agentes é simétrica, tentativas de dominação hierárquica encontram resistência. A ausência de um indivíduo específico com suficiente capital social para dominar o grupo implica em uma estrutura igualitária.

[more sources needed][this must be better explained]

[3.4.2] GRUPOS DE TAMANHO INTERMEDIÁRIO E/OU CAPACIDADE COGNITIVA INTERMEDIÁRIA

Para valores intermediários de a , os agentes possuem representações fluidas do panorama social de seu grupo, com flutuações grandes. Há uma pequena concentração de conectividade, que pode rapidamente flutuar entre um ou outro nó temporariamente central. Estatisticamente, o modelo ainda é simétrico. *[this must be better explained]*

[3.4.3] GRUPOS GRANDES E/OU CAPACIDADE COGNITIVA MENOR

Quando a é pequeno, ou seja, para grupos grandes e/ou agentes com menor capacidade cognitiva, existe uma quebra de simetria: as repre-

representações mentais da rede social dos agentes é centralizada e congelada em um grafo em forma de estrela. Cada um dos agentes possui uma representação mental assimétrica da rede social. O nó central do grafo de um agente se torna a única referência para todos os cálculos sociais a serem realizado por ele e todas as suas decisões em jogos sociais são tomadas levando em conta a natureza da relação dos outros nós com esse nó central.

Quando g é pequeno (baixo aprendizado via “*gossip*”), entretanto, os nós centrais de cada agente são aleatórios e, de certa forma, apesar de haver uma quebra de simetria na representação mental que cada agente faz do grupo, a situação global ainda é simétrica. Para valores maiores de g , a maioria dos agentes possui o mesmo modelo mental: um grafo em forma de estrela, centrado em torno do mesmo agente específico. O grupo usa as conexões desse mesmo agente central como informação mais relevante na tomada de decisões em jogos sociais. Esse agente central está posicionado de forma privilegiada na solução de dilemas sociais, formação de coalizões e outras atividades sociais do grupo. Fazendo a hipótese de que o capital social derivado dessa posição quebra a simetria do resultado de jogos sociais de maneira vantajosa ao agente central, pode-se esperar que esse agente atinja um certo grau de proeminência ou dominância. A simetria assumida na teoria da dominância reversa é quebrada, pois existe um agente com vantagens sociais claras.

[4] CONCLUSÃO E OBSERVAÇÕES FI- NAIS

[4.1] ...

[4.2] ...

[4.3] ...

[5] BIBLIOGRAFIA

- [1] A. Renyi. On measures of dependence. *Acta. Math. Acad. Sci. Hungar.*, 10:441–451, 1959.
- [2] R. S. Calsaverini and R. Vicente. An information-theoretic approach to statistical dependence: Copula information. *EPL (Europhysics Letters)*, 88(6):68003, 2009. URL <http://stacks.iop.org/0295-5075/88/i=6/a=68003>.
- [3] A. de Moivre. *The Doctrine of Chances: Or, A Method of Calculating the Probability of Events in Play*. W. Pearson, 1718. URL <http://books.google.com.br/books?id=3EPac6QpbuMC>.
- [4] P.S. Laplace. *Théorie analytique des probabilités*. Ve. Courcier, 1814. URL <http://books.google.com.br/books?id=6MRLAAAAMAAJ>.
- [5] P.S. Laplace. *Essai philosophique sur les probabilités*. Bachelier, 1840. URL <http://books.google.com.br/books?id=SAasyUD0K0mIC>.
- [6] R. T. Cox. Probability, frequency, and reasonable expectation. *Am. Jour. Phys.*, 14:1–13, 1946.
- [7] R.T. Cox. *Algebra of Probable Inference*. Johns Hopkins University Press, 2001. ISBN 9780801869822. URL <http://books.google.com.br/books?id=dcNpAUU6ACgC>.
- [8] C. E. Shannon. A mathematical theory of communication. *Bell System Technical Journal*, 47:379–423 and 623–656, 1948.
- [9] E.T. Jaynes and G.L. Bretthorst. *Probability Theory: The Logic of Science*. Cambridge University Press, 2003. ISBN 9780521592710. URL <http://books.google.com.br/books?id=tTN4HuUNXjgC>.
- [10] Ariel Caticha. Lectures on probability, entropy, and statistical physics. arxiv:0808.0012, 2008. URL <http://arxiv.org/abs/0808.0012>. Invited lecture at the 28th International Workshop on Bayesian Inference and Maximum Entropy Methods in Science and Engineering (July 8–13, 2008, Boraceia Beach, Sao Paulo, Brazil).

- [11] Ariel Caticha. Quantifying rational belief. arxiv:0908.3212, 2009. URL <http://arxiv.org/abs/0908.3212>. Presented at the 29th International Workshop on Bayesian Inference and Maximum Entropy Methods in Science and Engineering (July 5-10, 2009, Oxford, Mississippi, USA.) In.
- [12] Philip Goyal, Kevin H. Knuth, and John Skilling. Origin of complex quantum amplitudes and Feynman's rules. *Phys. Rev. A*, 81:022109, Feb 2010. DOI: 10.1103/PhysRevA.81.022109. URL <http://link.aps.org/doi/10.1103/PhysRevA.81.022109>. arxiv:0907.0909.
- [13] M. Tribus. *Rational descriptions, decisions, and designs*. Pergamon unified engineering series: engineering design section. Pergamon Press, 1969. URL <http://books.google.com.br/books?id=C4pRAAAAMAAJ>.
- [14] T.M. Cover and J.A. Thomas. *Elements of Information Theory*. Wiley, 2006. ISBN 9780471748816. URL <http://books.google.com.br/books?id=EuhBluW31hsC>.
- [15] S. Amari, H. Nagaoka, and D. Harada. *Jōhō Kika No Hōhō (Methods of Information Geometry)*. Translations of mathematical monographs v. 191. Amer Mathematical Society, 2000. ISBN 9780821843024. URL <http://books.google.com.br/books?id=vc2FWS07wLUC>.
- [16] L.D. Landau, E.M. Lifshitz, and L.P. Pitaevskii. *Statistical Physics Pt. 1*, volume 6 of *Course of Theoretical Physics*. Elsevier Science & Technology Books, 1980. ISBN 9780750626361. URL <http://books.google.com.br/books?id=NaB7oAkon9MC>.
- [17] Nestor Caticha and Renato Vicente. Agent-based social psychology: from neurocognitive processes to social data. *Advances in Complex Systems*, 14(05):711–731, 2011. DOI: 10.1142/S0219525911003190. URL <http://www.worldscientific.com/doi/abs/10.1142/S0219525911003190>.
- [18] S.R. Salinas. *Introdução a Física Estatística*. EDUSP, 1997. ISBN 9788531403866. URL <http://books.google.com.br/books?id=cA1P3sc0K44C>.
- [19] M. Oppen and D. Saad. *Advanced Mean Field Methods: Theory and Practice*. Neural Information Processing Series. Mit Press, 2001. ISBN 9780262150545. URL <http://books.google.com.br/books?id=cu0X8sCDeNAC>.

- [20] M. Mézard and A. Montanari. *Information, Physics, and Computation*. Oxford Graduate Texts. OUP Oxford, 2009. ISBN 9780198570837. URL <http://books.google.com.br/books?id=jhCM7i0a6UUC>.
- [21] A. Sklar. Fonctions de répartition à n dimensions et leurs marges. *Publ. Inst. Statist. Univ. Paris*, 8:229–231, 1959.
- [22] B. Schweizer and E. F. Wolff. On nonparametric measures of dependence for random variables. *The Annals of Statistics*, 9(4):879 – 885, 1981.
- [23] R.B. Nelsen. *An Introduction to Copulas*. Springer Series in Statistics. Springer, 2006. ISBN 9780387286594. URL <http://books.google.com.br/books?id=B30NT5rBv0wC>.
- [24] Jian Ma and Zengqi Sun. Mutual information is copula entropy. *Tsinghua Science and Technology*, 16(1):51–54, 2011. ISSN 1007-0214. DOI: 10.1016/S1007-0214(11)70008-6. arXiv:0808.0845.
- [25] Rick L. Jenison and Richard A. Reale. The shape of neural dependence. *Neural Computation*, 16:665 – 672, 2004.
- [26] S. Jones. The formula that felled Wall St. *The Financial Times*, Abril 2009. URL <http://www.ft.com/cms/s/2/912d85e8-2d75-11de-9eba-00144feabdc0.html>.
- [27] Alexander Kraskov, Harald Stögbauer, and Peter Grassberger. Estimating mutual information. *Phys. Rev. E*, 69:066138, 2004.
- [28] Stefano Demarta and Alexander J. McNeil. The t copula and related copulas. *International Statistical Review*, 73(1):111–129, 2005.
- [29] Lisa Borland. Option pricing formulas based on a non-gaussian stock price model. *Phys. Rev. Lett.*, 89(9):098701, Aug 2002. DOI: 10.1103/PhysRevLett.89.098701.
- [30] F. B. M. de Waal. *Chimpanzee Politics: Power and Sex among Apes*. Chimpanzee Politics. Johns Hopkins University Press, 2007. ISBN 9780801886560. URL <http://books.google.com.br/books?id=XsrhU2vV5PIC>.
- [31] C Boehm. *Hierarchy in the Forest: The Evolution of Egalitarian Behavior*. Harvard University Press, 2001. ISBN 9780674006911. URL <http://books.google.com.br/books?id=ljxS8gUlgqgC>.
- [32] Sandra L. Vehrencamp. A model for the evolution of despotic versus egalitarian societies. *Animal Behaviour*, 31(3):667 –

- 682, 1983. ISSN 0003-3472. DOI: 10.1016/S0003-3472(83)80222-X. URL <http://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S000334728380222X>.
- [33] Bruce M. Knauft, Thomas S. Abler, Laura Betzig, Christopher Boehm, Robert Knox Dentan, Thomas M. Kiefer, Keith F. Otterbein, Tohn Paddock, and Lars Rodseth. Violence and sociality in human evolution [and comments and replies]. *Current Anthropology*, 32:391–428, 1991. URL <http://www.jstor.org/stable/2743815>.
- [34] Joyce Marcus. The archeological evidence for social evolution. *Annu. Rev. Anthropol.*, 37:25166, 2008.
- [35] Thomas E. Currie, Simon J. Greenhill, Russell D. Gray, Toshikazu Hasegawa, and Ruth Mace. Rise and fall of political complexity in island south-east asia and the pacific. *Nature*, 467(7317):801–804, Oct. 2010. DOI: 10.1038/nature09461.
- [36] T Sawaguchi and H Kudo. Neocortical development and social structure in primates. *Primates*, pages 283–90, 1990.
- [37] Robin Dunbar. Neocortex size as a constraint on group size in primates. *Journal of Human Evolution*, 20:469–93, 1992.
- [38] R. I. M. Dunbar. Coevolution of neocortical size, group size and language in humans. *Behavioral and Brain Sciences*, 16:681–694, 11 1993. ISSN 1469-1825. DOI: 10.1017/S0140525X00032325. URL <http://dx.doi.org/10.1017/S0140525X00032325>.
- [39] Leslie C. Aiello and R. I. M. Dunbar. Neocortex size, group size, and the evolution of language. *Current Anthropology*, 34(2):184–193, 1993.
- [40] Tracey H. Joffe and R. I. M. Dunbar. Visual and socio-cognitive information processing in primate brain evolution. *Proceedings of the Royal Society of London. Series B: Biological Sciences*, 264(1386):1303–1307, 1997. DOI: 10.1098/rspb.1997.0180. URL <http://rspb.royalsocietypublishing.org/content/264/1386/1303.abstract>.
- [41] R. I. M. Dunbar. The social brain hypothesis and its implications for social evolution. *Annals of human biology*, 36(5):562–72, 2009. DOI: 10.1080/03014460902960289.
- [42] R W Byrne and A Whiten. Tactical deception in primates: the 1990 database. *Primate Report, Whole Volume*, 27:1–101, 1990.
- [43] R W Byrne and A Whiten. Computation and mindreading in primate tactical deception. In A Whiten, editor, *Natural Theories of Mind*. Blackwells, Oxford, 1991.

- [44] R W Byrne and A Whiten. Cognitive evolution in primates: evidence from tactical deception. *Man*, 27:609–627, 1992.
- [45] Andrew Whiten and David Erdal. The human socio-cognitive niche and its evolutionary origins. *Phil. Trans. R. Soc. B*, 367:2119–2129, 2012.
- [46] R. I. M. Dunbar. Cognitive constraints on the structure and dynamics of social networks. *Group Dynamics: Theory, Research, and Practice*, 12(1):7–16, 2008.
- [47] Susanne Shultz and Robin Dunbar. Encephalization is not a universal macroevolutionary phenomenon in mammals but is associated with sociality. *Proceedings of the National Academy of Sciences of the United States of America*, 107(50):21582–6, dec 2010. ISSN 1091-6490. DOI: 10.1073/pnas.1005246107. URL <http://www.pubmedcentral.nih.gov/articlerender.fcgi?artid=3003036&tool=pmcentrez&rendertype=abstract>.
- [48] F. B. M. de Waal. *Peacemaking Among Primates*. Harvard University Press, 1990. ISBN 9780674659216. URL <http://books.google.com.br/books?id=5at0TN8U6RMC>.
- [49] P. Erdős and A. Rényi. On the evolution of random graphs. *Publ. Math. Inst. Hung. Acad. Sci*, 5:17–61, 1960.
- [50] M. E. J. Newman, S. H. Strogatz, and D. J. Watts. Random graphs with arbitrary degree distributions and their applications. *Phys. Rev. E*, 64:026118, Jul 2001. DOI: 10.1103/PhysRevE.64.026118. URL <http://link.aps.org/doi/10.1103/PhysRevE.64.026118>.
- [51] R. I. M. Dunbar. *How Many Friends Does One Person Need? Dunbar's Number and Other Evolutionary Quirks*. Harvard University Press, 2010. ISBN 9780674057166. URL <http://books.google.com.br/books?id=W-kkeffNx5MC>.
- [52] J. Aczél and Z. Daróczy. *On Measures of Information and Their Characterizations*. Mathematics in science and engineering vol.115. Acad. Press, 1975. ISBN 9780120437603. URL <http://books.google.com.br/books?id=9Xsj7AWmV8UC>.

[A] PROVAS DOS TEOREMAS DE COX

Este apêndice contém demonstrações dos teoremas exibidos na seção 1.2.1, *Probabilidades e Inferência*.

[A.1] PRIMEIRO TEOREMA DE COX E A REGRA DO PRODUTO

[this must be better explained]

Por exemplo, a conjunção booleana (\wedge) é uma operação associativa, ou seja:

$$P_1 \wedge (P_2 \wedge P_3) = (P_1 \wedge P_2) \wedge P_3.$$

Isso implica também na associatividade da função $G(u, v)$, ou seja:

$$G(G(u, v), w) = G(u, G(v, w)).$$

Esse vínculo é satisfeito por infinitas possíveis funções $G(u, v)$, porém todas elas ¹ têm a forma:

$$G(u, v) = g^{-1}(g(u)g(v))$$

com $g(\cdot)$ uma função monotônica. Sendo $g(u)$ monotônica, pode-se redefinir a atribuição de números reais às plausibilidades para $g(P|Q)$ sem perder o ordenamento de proposições segundo suas plausibilidades. Ao fazer isso podemos enunciar o primeiro teorema de Cox: A equação (1.1) é remanescente da regra do produto da Teoria das Probabilidades, o que indica o objetivo do presente raciocínio.

[A.2] VALORES EXTREMOS

[this must be better explained]

Sejam ² P_T e P_F os valores associados à plausibilidade regrada $\pi(\cdot|\cdot)$ de eventos sabidamente verdadeiros ou falsos, respectivamente³. Se P é sabido verdadeiro, então a plausibilidade de que P e Q sejam simultaneamente verdadeiros é exatamente a plausibilidade de apenas Q ser verdadeiro, ou seja, $\pi(P \wedge Q|P) = \pi(Q|P)$. Mas, pela regra do produto:

$$\pi(P \wedge Q|P) = \pi(P|P)\pi(Q|P \wedge P) = P_T\pi(Q|P)$$

¹ J. Aczél and Z. Daróczy. *On Measures of Information and Their Characterizations*. Mathematics in science and engineering vol.115. Acad. Press, 1975. ISBN 9780120437603. URL <http://books.google.com.br/books?id=9Xsj7AwMv8UC>; and Ariel Caticha. Lectures on probability, entropy, and statistical physics. arxiv:0808.0012, 2008. URL <http://arxiv.org/abs/0808.0012>. Invited lecture at the 28th International Workshop on Bayesian Inference and Maximum Entropy Methods in Science and Engineering (July 8-13, 2008, Boracéia Beach, Sao Paulo, Brazil)

² Das palavras inglesas “true” e “false”, respectivamente.

³ Requisitos de consistência exigem que sejam iguais para quaisquer proposições falsas ou verdadeiras

Dessa forma, $P_T \pi(Q|P) = \pi(Q|P)$, para quaisquer Q e P , o que implica em $P_T = 1$. Da mesma forma, a plausibilidade de que simultaneamente P e \bar{P} sejam verdadeiros, dada uma proposição Q qualquer, deve ser P_F , pois é uma contradição. Mas, pela regra do produto:

$$\pi(P \wedge \bar{P}|Q) = \pi(P|Q \wedge \bar{P})\pi(\bar{P}|Q)$$

Independentemente de Q , $\pi(P|Q \wedge \bar{P})$ deve ser também igual a P_F e, assim, $P_F = P_F \pi(\bar{P}|Q)$, para quaisquer P e Q . Duas soluções são possíveis: $P_F = 0$ ou $P_F = \infty$. Uma vez que quaisquer das soluções para P_F pode ser mapeada na outra por uma regradação monotônica, pode-se arbitrariamente escolher $P_F = 0$, e assim limitar valores de $\pi(P|Q)$ no intervalo $[0, 1]$.

[A.3] TEOREMA DE BAYES

[this must be better explained]

Uma consequência imediata da regra do produto segue da seguinte observação. Uma vez que a conjunção $P \wedge Q$ é simétrica:

$$\pi(P_1 \wedge P_2|Q) = \pi(P_2 \wedge P_1|Q)$$

Aplicando a regra do produto em ambos os membros da equação acima, temos:

$$\pi(P_2|Q \wedge P_1)\pi(P_1|Q) = \pi(P_1|Q \wedge P_2)\pi(P_2|Q)$$

e portanto:

$$\pi(P_2|Q \wedge P_1) = \frac{\pi(P_1|Q \wedge P_2)\pi(P_2|Q)}{\pi(P_1|Q)} \quad (\text{A.1})$$

que é similar ao teorema de Bayes da Teoria de Probabilidades.

[A.4] REGRA DA SOMA

[this must be better explained]

Considere as proposições P , S e $Q = \overline{P \wedge S}$. Note, em primeiro lugar, que:

$$P \wedge \bar{Q} = P \wedge (P \wedge S) = P \wedge S = \bar{Q}.$$

Note ainda que:

$$\overline{P \wedge Q} = P \vee \bar{Q} = P \vee (P \wedge S) = P,$$

e portanto $\bar{P} \wedge Q = \bar{P}$ e $P \wedge \bar{Q} = \bar{Q}$.

Considere a seguir a plausibilidade regrada dada por $\pi(P \wedge Q|R) = \pi(P|R)\pi(Q|P \wedge R)$. Note que a função $F(\cdot)$ deve ser idempotente, uma vez que $\bar{P} = P$ implica que $F(F(u)) = u$. Portanto,

$$\pi(Q|S) = F(\pi(\bar{Q}|S))$$

para qualquer S . Assim, usando a regra do produto:

$$\pi(P \wedge Q|R) = \pi(P|R)F(\pi(\bar{Q}|P \wedge R)) \quad (\text{A.2})$$

$$= \pi(P|R)F\left(\frac{\pi(\bar{Q} \wedge P|R)}{\pi(P|R)}\right). \quad (\text{A.3})$$

Mas a mesma operação pode ser feita em outra ordem – uma vez que a conjunção $P \wedge Q$ é simétrica na troca de P por Q e, portanto:

$$\pi(P \wedge Q|R) = \pi(P|R)F\left(\frac{\pi(\bar{Q} \wedge P|R)}{\pi(P|R)}\right) = \pi(Q|R)F\left(\frac{\pi(\bar{P} \wedge Q|R)}{\pi(Q|R)}\right)$$

para quaisquer P , Q e R . Em particular, deve valer para o caso particular em que $\bar{Q} = P \wedge S$. Nesse caso, é possível mostrar, através das regras da álgebra booleana, que $P \wedge \bar{Q} = \bar{Q}$ e que $\bar{P} \wedge Q = \bar{P}^4$. Finalmente isso significa que:

$$uF\left(\frac{v}{u}\right) = vF\left(\frac{u}{v}\right)$$

Novamente, há infinitas soluções $F(\cdot)$ para esse vínculo, mas todas elas satisfazem⁵:

$$f(u)^\alpha + u^\alpha = 1, \quad (\text{A.4})$$

o que, regraduando as plausibilidades novamente por uma transformação monotônica $p(P|Q) = \pi(P|Q)^\alpha$, que preserva os valores $P_F = 0$ e $P_V = 1$, permite enunciar o segundo teorema de Cox.

Teorema 5 (2º teorema de regraduação de Cox). *Uma vez que uma representação consistente de plausibilidades $\pi(P|Q)$ com um ordenamento bem definido foi encontrada para a qual vale a regra do produto, sempre é possível encontrar uma outra equivalente $p(P|Q)$ tal que:*

$$p(P|Q) + p(\bar{P}|Q) = 1 \quad (\text{A.5})$$

Essa é denominada a regra da soma. A partir das regras da soma e do produto todas as outras regras comuns da teoria de probabilidades podem ser facilmente derivadas. Por exemplo a regra de Bayes vem diretamente da regra do produto através da identificação:

$$p(Q|R \wedge P)P(Q|R) = p(P \wedge Q|R) = p(P|R \wedge Q)P(Q|R). \quad (\text{A.6})$$

A forma mais geral da regra da soma:

$$p(Q|R) + p(P|R) = p(Q \vee P|R) + p(Q \wedge P|R) \quad (\text{A.7})$$

também pode ser deduzida dessas duas regras. Isso leva à conclusão de que, se há uma teoria consistente de inferência sobre informação incompleta representada por números reais, essa teoria deve ser idêntica à teoria das probabilidades. Por essa razão, chamaremos o funcional $p(\cdot|\cdot)$ de probabilidade, daqui por diante.

⁴ Basta notar que:

$$P \wedge \bar{Q} = P \wedge (P \wedge S) = (P \wedge P) \wedge S = P \wedge S = \bar{Q}$$

Para simplificar o outro caso, note que $\bar{P} \wedge \bar{Q} = \bar{P} \wedge (P \wedge S)$ e é falso, pois é uma contradição. Mas $\bar{P} \wedge \bar{Q} = \bar{P} \vee \bar{Q}$ (\vee representando a disjunção “OU”), o que implica que $P \vee Q$ é verdadeiro. uma vez que $A \wedge V = A$, para qualquer A , temos $\bar{P} \wedge (P \vee Q) = \bar{P}$. Mas:

$$\bar{P} = \bar{P} \wedge (P \vee Q) = (\bar{P} \wedge P) \vee (\bar{P} \wedge Q) = F \vee (\bar{P} \wedge Q) = \bar{P} \wedge Q$$

onde usamos o fato que $F \vee A = A$ para qualquer A e que $A \wedge (B \vee C) = (A \wedge B) \vee (A \wedge C)$.

⁵ J. Aczél and Z. Daróczy. *On Measures of Information and Their Characterizations*. Mathematics in science and engineering vol.115. Acad. Press, 1975. ISBN 9780120437603. URL <http://books.google.com.br/books?id=9Xsj7AWmV8UC>; and Ariel Caticha. *Lectures on probability, entropy, and statistical physics*. arxiv:0808.0012, 2008. URL <http://arxiv.org/abs/0808.0012>. Invited lecture at the 28th International Workshop on Bayesian Inference and Maximum Entropy Methods in Science and Engineering (July 8-13, 2008, Boraceia Beach, Sao Paulo, Brazil)

[B] PROPRIEDADES DE GRAFOS DO
ENSEMBLE DE ERDÖS-RÉNYI