

マルコフ連鎖

樋口さぶろお

龍谷大学工学部数理情報学科

計算科学☆実習 B L04(2018-05-01 Tue)

最終更新: Time-stamp: "2018-05-07 Mon 11:40 JST hig"

今日の目標

- 転置確率行列, 確率ベクトルの定義を説明できる
- マルコフ連鎖の定義を説明できる
- 現象から転置推移確率行列を書ける
- 定常分布を求められる



<http://hig3.net>

L03-Q1

Quiz 解答:ランダムウォークの座標の確率分布

①

$$P(X(2) = x) = \begin{cases} p^0(1-p)^2 & (x = 0) \\ 2p^1(1-p)^1 & (x = 1) \\ p^2(1-p)^0 & (x = 2) \end{cases}$$

② $E[X(2)] = 2p.$

③ $V[X(2)] = 2p(1-p).$

④ $P(X(2) > 0) = E[\mathbf{1}_{[X>0]}(X(2))] = 2p(1-p) + p^2.$

L03-Q2

Quiz 解答:離散的なランダムウォークの確率の漸化式

$$p(x, t) = \frac{1}{7} \times p(x - 2, t - 1) + \frac{2}{7} \times p(x, t - 1) + \frac{4}{7} \times p(x + 1, t - 1),$$

$$p(x, 5) = \begin{cases} 1 & (x = 2) \\ 0 & (\text{他}) \end{cases}$$

L03-Q3

Quiz 解答:離散的なランダムウォークの確率の漸化式

$$p(x, t) = \frac{1}{8} \times p(x - 1, t - 1) + \frac{4}{8} \times p(x, t - 1) + \frac{3}{8} \times p(x + 2, t - 1),$$

$$p(x, 3) = \begin{cases} 1 & (x = 2) \\ 0 & (\text{他}) \end{cases}$$

L03-Q4

Quiz 解答:ランダムウォークの確率 $p(x, t)$ の漸化式

空欄は 0.

$t \backslash x$...	-3	-2	-1	0	1	2	3	...	x	...
0	...				1			
1	...				$\frac{1}{3}$	$\frac{2}{3}$		
2	...				$\frac{1}{9}$	$\frac{2}{9}$	$\frac{2}{9}$	
3	...				$\frac{1}{27}$	$\frac{6}{27}$	$\frac{12}{27}$	$\frac{8}{27}$

L03-Q5

Quiz 解答:ランダムウォークの確率 $p(x, t)$ の漸化式

$t \backslash x$	-2	-1	0	1	2	3	4	5	6	7
0	0	0	0	0.5	0	0.5	0	0	0	0
1	0	0	0.4	0	0.5	0	0.1	0	0	0
2	0	0.32	0	0.48	0	0.18	0	0.02	0	0

ここまで来たよ

3 ランダムウォークの確率の漸化式と初期条件

4 マルコフ連鎖

- (復習) $p(x, t)$ の漸化式
- 確率ベクトル, 転置確率行列
- 定常分布, 分布の時間発展

ランダムウォークと $p(x, t)$ の定義

ランダムウォーカーの時刻 t の座標 $X(t)$ は漸化式と初期条件

$$X(t) = X(t-1) + R(t), \quad P(X(a) = b) = 1.$$

に従う. $R(t)$ ($t = a+1, a+2, \dots$) は独立同分布に従う確率変数.

$p(x, t)$ の定義

時刻 t に, ウォーカーが x にいる確率 $p(x, t) = P(X(t) = x)$.

性質 $\forall t \quad \sum_{x=-\infty}^{+\infty} p(x, t) = 1$

ルールの $p(x, t)$ の漸化式への変換

「ランダムウォーカーが時刻 $t-1$ に x にいるとき、時刻 t には、確率 p で $x+1$ に、確率 q で $x-1$ に移動、確率 $1-p-q$ でその場にとどまる」

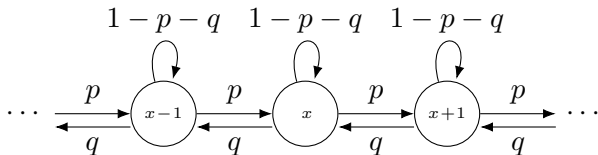
↓

$$X(t) = X(t-1) + R(t), \quad P(R(t) = r) = \begin{cases} q & (r = -1) \\ 1 - p - q & (r = 0) \\ p & (r = 1) \\ 0 & (\text{他}) \end{cases}$$

↓

$$p(x, t) = p \cdot p(x-1, t-1) + (1-p-q) \cdot p(x, t-1) + q \cdot p(x+1, t-1).$$

推移図 推移=transition

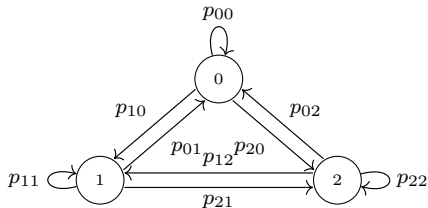


マルコフ連鎖の例 I

空間の移動でなく、
 ウォーカー:猫 0:食べる 1:寝る 2:遊ぶ の
 間の状態遷移と思ってもよい。

状態空間 $S = \{0, 1, 2\}$

状態 $x = 0$:食べる,...



推移確率

条件付き確率 確率統計☆演習 II(2018)L01

$$p_{xy} = P(X(t) = x | X(t-1) = y)$$

上の量を、世の中では p_{xy} でなく p_{yx} と書くこともある。

マルコフ連鎖 「このような」状態空間と、推移確率の組。

$p(x, t)$ の漸化式

$$p(0, t) = p_{00} \cdot p(0, t-1) + p_{01} \cdot p(1, t-1) + p_{02} \cdot p(2, t-1)$$

$$p(1, t) = p_{10} \cdot p(0, t-1) + p_{11} \cdot p(1, t-1) + p_{12} \cdot p(2, t-1)$$

$$p(2, t) = p_{20} \cdot p(0, t-1) + p_{21} \cdot p(1, t-1) + p_{22} \cdot p(2, t-1)$$

$$\begin{pmatrix} p(0, t) \\ p(1, t) \\ p(2, t) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} p_{00} & p_{01} & p_{02} \\ p_{10} & p_{11} & p_{12} \\ p_{20} & p_{21} & p_{22} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} p(0, t-1) \\ p(1, t-1) \\ p(2, t-1) \end{pmatrix}$$

$$p(x, t) = \sum_{y=0,1,2} p_{xy} \cdot p(y, t-1). \quad (x = 0, 1, 2)$$

転置推移確率行列 M , ベクトル $\vec{p}(t)$ で書くと (x, y が成分番号)

$$\vec{p}(t) = M\vec{p}(t-1).$$

ベクトル $\vec{p}(t)$ は, 先週の横 x , 縦 t の表の横 1 行に相当.

この漸化式を解くと, $\vec{p}(t) = M\vec{p}(t-1) = M^2\vec{p}(t-2) = \dots = M^t\vec{p}(0)$.

L04-Q1

Quiz(マルコフ連鎖の推移確率行列)

$x = 0, 1, 2, 3$ 上のランダムウォークを考える.

時刻 $t = 0$ に $x = 1$ から出発する. 時刻 t に x にいたウォーカーは,

- 確率 $\frac{1}{7}$ で $x - 1$ に移動し
- 確率 $\frac{2}{7}$ で $x + 1$ に移動し
- 確率 $\frac{4}{7}$ で x にとどまる

ただし, 上のルールで, $x = 0$ から $x = -1$ や, $x = 3$ から $x = 4$ に移動しようとしたときは, 元の x にとどまるものとする.

これをマルコフ連鎖としてとらえたとき,

- 1 推移図を書こう.
- 2 転置推移確率行列を書こう.

L04-Q2

Quiz(マルコフ連鎖の推移確率行列)

$x = 0, 1, 2, 3$ 上のランダムウォークを考える.

時刻 $t = 0$ に $x = 1$ から出発する. 時刻 t に x にいたウォーカーは,

- 確率 $\frac{1}{7}$ で $x - 1$ に移動し
- 確率 $\frac{2}{7}$ で $x + 1$ に移動し
- 確率 $\frac{4}{7}$ で x にとどまる

ただし, 上のルールで, $x = 0$ から $x = -1$ に移動しようとしたときには $x = 3$ に行く, $x = 3$ から $x = 4$ に移動しようとしたときには $x = 0$ に行くものとする.

これをマルコフ連鎖としてとらえたとき,

- ① 推移図を書こう.
- ② 転置推移確率行列を書こう.

ここまで来たよ

3 ランダムウォークの確率の漸化式と初期条件

4 マルコフ連鎖

- (復習) $p(x, t)$ の漸化式
- 確率ベクトル, 転置確率行列
- 定常分布, 分布の時間発展

線形代数のりで確率ベクトル, 転置確率行列の言葉を準備 I

非負ベクトル

m 次元ベクトル $\begin{pmatrix} p_0 \\ p_1 \\ \vdots \\ p_{m-1} \end{pmatrix}$ が $p_i \geq 0$ を満たすとき, **非負ベクトル**という.

確率ベクトル

非負ベクトル $\begin{pmatrix} p_0 \\ p_1 \\ \vdots \\ p_{m-1} \end{pmatrix}$ が, **規格化** $\sum_{i=0}^{m-1} p_i = 1$ を満たすとき, **確率ベクトル**という.

離散型確率分布 $f(x)$ は, 確率ベクトルと1対1に対応.

$$\vec{p} = \begin{pmatrix} p_0 \\ p_1 \\ p_2 \\ \vdots \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f(0) \\ f(1) \\ f(2) \\ \vdots \end{pmatrix}$$

非負行列 ($n \times m = 3 \times 2$ の例で)

実行列 $\begin{pmatrix} p_{00} & p_{01} \\ p_{10} & p_{11} \\ p_{20} & p_{21} \end{pmatrix}$ が $p_{ij} \geq 0$ を満たすとき **非負行列** という.

転置確率行列

行列 $M = \begin{pmatrix} p_{00} & p_{01} \\ p_{10} & p_{11} \\ p_{20} & p_{21} \end{pmatrix}$ の各列ベクトルが確率ベクトルであるとき, つまり

$\forall j \sum_{i=0}^{n-1} p_{ij} = 1$ であるとき, M を **転置確率行列** という.

推移確率行列

転置推移確率行列

マルコフ連鎖に現れる, 転置確率行列

$$M = \begin{pmatrix} p_{00} & p_{01} & p_{02} \\ p_{10} & p_{11} & p_{12} \\ p_{20} & p_{21} & p_{22} \end{pmatrix}$$

を, マルコフ連鎖の**転置推移確率行列**という. $m \times m$ 正方行列.

漸化式 $\vec{p}(t) = M\vec{p}(t-1)$ の解

$$\vec{p}(t) = M\vec{p}(t-1) = M^2\vec{p}(t-2) = \dots = M^t\vec{p}(0).$$

転置確率行列と確率ベクトルの積

M が転置確率行列, \vec{p} が確率ベクトルのとき, $M\vec{p}$ も確率ベクトル

証明:

確率過程とマルコフ連鎖

確率過程 時間 t に依存する確率変数

もちろん反復試行から来る独立な確率変数群 $R(t)$ も時間 t に依存するけど, 独立じゃない場合がおもしろい

離散時間マルコフ連鎖は, 次の性質を満たす確率過程.

離散時間 t が離散的. $t = 0, 1, 2, \dots$

マルコフ Markov $\bar{p}(t)$ が直前の時刻の分布 $\bar{p}(t-1)$ だけから決まる. 転置推移確率行列 p_{xy} で表現できる.

連鎖 chain 状態空間 $S \ni x$ が離散的.

いま考えてる, 時間空間離散のランダムウォークや猫は離散時間マルコフ連鎖の典型例.

離散時間マルコフ連鎖の (確率) 分布は, 確率ベクトルで表現できる.

離散時間マルコフ連鎖の遷移確率は, 転置確率行列で表現できる.

ここまで来たよ

3 ランダムウォークの確率の漸化式と初期条件

4 マルコフ連鎖

- (復習) $p(x, t)$ の漸化式
- 確率ベクトル, 転置確率行列
- 定常分布, 分布の時間発展

定常分布

$\vec{p} = M\vec{p}$ となる分布 \vec{p} を **定常分布** という.

意味

線形代数の言葉で言うと, 定常分布は, 転置推移確率行列 M

の

建設的心配性大爆発

- 定常分布っていつでもある? \rightsquigarrow Yes
- 固有値 (の絶対値) が 1 より大きな固有ベクトルはあるの? \rightsquigarrow No

状態数 m が有限のとき, **ペロン・フロベニウスの定理**から言える.

固有値 1 の存在

転置確率行列は 固有値 1 を持つ.

分布の時間発展 I

L04-Q3

Quiz(マルコフ連鎖の時間発展)

状態空間 $\{0, 1\}$ 上のマルコフ連鎖を考える. 転置推移確率行列は

$$M = \begin{pmatrix} \frac{1}{3} & \frac{1}{2} \\ \frac{2}{3} & \frac{1}{2} \end{pmatrix}.$$

- 1 定常分布をすべて求めよう.
- 2 初期分布 $\vec{p}(0) = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$ のとき $\vec{p}(1)$ を求めよう.
- 3 この初期分布のとき $\vec{p}(t)$ を求めよう.
- 4 初期分布 $\vec{p}(0) = \frac{1}{2} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$ のとき $\vec{p}(t)$ を求めよう.

$t \rightarrow +\infty$ のとき

L04-Q4

Quiz(マルコフ連鎖の定常分布)

次の転置推移確率行列を持つ状態空間 $\{0, 1, 2\}$ 上のマルコフ連鎖を考えよう.

$$M = \begin{pmatrix} \frac{3}{4} & \frac{1}{4} & 0 \\ \frac{1}{4} & \frac{2}{4} & \frac{1}{4} \\ 0 & \frac{1}{4} & \frac{3}{4} \end{pmatrix}$$

なお, M の固有値固有ベクトルは $\lambda = 1, \frac{3}{4}, \frac{1}{4}$, $\vec{u} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ -2 \\ 1 \end{pmatrix}$ であることを使ってよい.

- 1 定常分布をすべて求めよう.
- 2 初期分布 $\vec{p}(0) = \frac{1}{3} \begin{pmatrix} 2 \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}$ のとき $\vec{p}(t)$ を求めよう.

お知らせ

Quiz の提出は写真の縦横を正しく. スマホをちょっと傾けて.

<https://learn.math.ryukoku.ac.jp/moodle>



アプリ Moodle Mobile. App-Store, Google Play. 登録する URL は左.



- チューター/Math ラウンジ 月火水木昼 1-614
- 2018-05-07 月 統計検定の申込締切
- 2018-06-17 統計検定の瀬田学舎団体受験
- 2018-05-15 火 このころ, 火曜日にも実習やるかも
- 2018-05-29 火 プチテスト (筆記)
- Visual Studio 自宅インストールおすすめ中. 計算科学☆実習のページから.