

離散数理工学 第 12 回
離散確率論：乱択データ構造とアルゴリズム (発展)

岡本 吉央
okamotoy@uec.ac.jp

電気通信大学

2020 年 1 月 14 日

最終更新：2020 年 1 月 13 日 11:59

- | | | |
|---|----------------------|---------|
| 1 | 数え上げの基礎：二項係数と二項定理 | (10/1) |
| 2 | 数え上げの基礎：漸化式の立て方 | (10/8) |
| 3 | 数え上げの基礎：漸化式の解き方 (基礎) | (10/15) |
| ★ | 休み (祝日) | (10/22) |
| 4 | 数え上げの基礎：漸化式の解き方 (発展) | (10/29) |
| 5 | 離散代数：図形とグラフの対称性 | (11/5) |
| 6 | 離散代数：有限群 | (11/12) |
| 7 | 離散代数：有限群の構造 | (11/19) |
| 8 | 離散代数：有限群の構造 (続き) | (11/26) |

スケジュール 後半 (予定)

- | | | |
|----|---------------------------|---------|
| 9 | 離散確率論：確率的離散システムの解析 (基礎) | (12/3) |
| ★ | 中間試験 | (12/10) |
| 10 | 離散確率論：確率的離散システムの解析 (発展) | (12/17) |
| 11 | 離散確率論：乱択データ構造とアルゴリズム (基礎) | (1/7) |
| 12 | 離散確率論：乱択データ構造とアルゴリズム (発展) | (1/14) |
| 13 | 離散確率論：マルコフ連鎖 (基礎) | (1/21) |
| 14 | 離散確率論：マルコフ連鎖 (発展) | (1/28) |
| ★ | 授業等調整日 | (2/4) |
| ★ | 期末試験 | (2/18?) |

注意：予定の変更もありうる

今日の目標

典型的な乱択アルゴリズムの設計と解析ができるようになる

- ▶ 確率の推定 (中央値トリック)

目次

- ① 確率の推定：単純なアルゴリズム
- ② 確率の推定：中央値トリック
- ③ 今日のまとめ

不公平な硬貨

設定

- ▶ 硬貨が1つある
- ▶ 投げたとき、表が出る確率はいつも変わらない
- ▶ その確率が分からない
- ▶ **目標**：表が出る確率を知りたい
- ▶ 可能な操作：硬貨を投げる（こののみ）

不公平な硬貨

設定

- ▶ 考えている硬貨について

$$\Pr(\text{表}) = p$$

ただし, $0 \leq p \leq 1$

- ▶ 目標 : p を知りたい

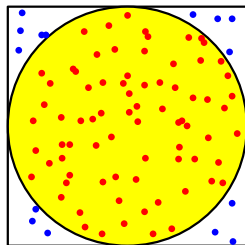
応用例：モンテカルロ法

モンテカルロ法：(実際には用いられない) 例

円周率の計算のために次を行う

- 1 $[-1, 1]^2$ 内の点 (x, y) を一様分布に従って発生させる
 - 2 $x^2 + y^2 \leq 1$ ならば、1 を出力、そうでなければ 0 を出力
- このとき、この方法が 1 を出力する確率 $= \pi/4$

つまり、 $p = \pi/4$ とした不公平な硬貨を考えていることになる



モンテカルロ法は、次の「単純なアルゴリズム」を実行する

単純なアルゴリズム

単純なアルゴリズム

硬貨を何度も投げてみる

- ▶ n 回投げるとする (独立な試行)
- ▶ 確率変数 X_i を次で定義 ($i \in \{1, \dots, n\}$)

$$X_i = \begin{cases} 0 & (i \text{ 回目に投げたとき裏が出る}) \\ 1 & (i \text{ 回目に投げたとき表が出る}) \end{cases}$$

- ▶ 次の量を出力

$$\frac{X_1 + X_2 + \dots + X_n}{n}$$

期待値の解析

- ▶ 出力の期待値は

$$\begin{aligned}
 E\left[\frac{X_1 + X_2 + \cdots + X_n}{n}\right] &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n E[X_i] \\
 &= \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (0 \cdot (1-p) + 1 \cdot p) \\
 &= p
 \end{aligned}$$

期待値は正しい「推測」になっている (不偏推定)

問題点

必ず「 p 」を出力するわけではない \rightsquigarrow 誤差が出る

n を大きくすれば、誤差は小さくなりそう

誤差の解析 (1)

以後、 $X = X_1 + X_2 + \dots + X_n$ とする

- ▶ 真の値 p から出力 $\frac{X}{n}$ がどれだけずれるか？
- ▶ そのずれが ε 未満である確率を知りたい
- ▶ その確率は次のように書ける

$$\Pr \left(\left| \frac{X}{n} - p \right| < \varepsilon \right)$$

- ▶ 計算

$$\Pr \left(\left| \frac{X}{n} - p \right| < \varepsilon \right) = 1 - \Pr \left(\left| \frac{X}{n} - p \right| \geq \varepsilon \right),$$

$$\Pr \left(\left| \frac{X}{n} - p \right| \geq \varepsilon \right) \leq \frac{\mathbb{E} \left[\left| \frac{X}{n} - p \right| \right]}{\varepsilon} \quad (\text{マルコフの不等式})$$

しかし、 $\mathbb{E} \left[\left| \frac{X}{n} - p \right| \right]$ はどう計算したらいいかわからない

誤差の解析 (2)

$$\Pr\left(\left|\frac{X}{n} - p\right| \geq \varepsilon\right) = \Pr\left(\left|\frac{X}{n} - p\right|^2 \geq \varepsilon^2\right) \leq \frac{E\left[\left|\frac{X}{n} - p\right|^2\right]}{\varepsilon^2}$$

$E\left[\left|\frac{X}{n} - p\right|^2\right]$ を計算してみる

誤差の解析 (3)

$$E \left[\left| \frac{X}{n} - p \right|^2 \right] = E \left[\left(\frac{X}{n} \right)^2 - 2p \frac{X}{n} + p^2 \right] = \frac{1}{n^2} E[X^2] - \frac{2p}{n} E[X] + p^2$$

ここで,

$$E[X] = E[X_1 + \cdots + X_n] = \sum_{i=1}^n E[X_i] = pn$$

$$E[X^2] = E[(X_1 + \cdots + X_n)^2] = \sum_{i=1}^n E[X_i^2] + \sum_{i=1}^n \sum_{j=1, (i \neq j)}^n E[X_i X_j]$$

誤差の解析 (4)

任意の $i \in \{1, \dots, n\}$ に対して

$$E[X_i^2] = (1 - p) \cdot 0^2 + p \cdot 1^2 = p$$

したがって,

$$\sum_{i=1}^n E[X_i^2] = pn$$

任意の異なる $i, j \in \{1, \dots, n\}$ に対して, X_i と X_j は独立なので,

$$E[X_i X_j] = E[X_i] E[X_j] = p \cdot p = p^2$$

したがって,

$$\sum_{i=1}^n \sum_{j=1, (i \neq j)}^n E[X_i X_j] = p^2 n(n-1)$$

誤差の解析 (5)

ここまで、まとめると

$$\begin{aligned}
 E \left[\left| \frac{X}{n} - p \right|^2 \right] &= \frac{1}{n^2} E[X^2] - \frac{2p}{n} E[X] + p^2 \\
 &= \frac{1}{n^2} (pn + p^2 n(n-1)) - \frac{2p}{n} pn + p^2 \\
 &= \frac{p}{n} + \frac{p^2(n-1)}{n} - p^2 \\
 &= \frac{p - p^2}{n} \\
 &= \frac{p(1-p)}{n}
 \end{aligned}$$

誤差の解析 (6)

すなわち,

$$\Pr\left(\left|\frac{X}{n} - p\right| \geq \varepsilon\right) \leq \frac{E\left[\left|\frac{X}{n} - p\right|^2\right]}{\varepsilon^2} = \frac{1}{\varepsilon^2} \frac{p(1-p)}{n}$$

- ▶ この不等式は**チェビシェフの不等式**と呼ばれる (ものの特殊な場合)
- ▶ この右辺を δ 以下にするには, $n \geq \frac{1}{\varepsilon^2} \frac{p(1-p)}{\delta}$ とすればよい

結論

誤差が ε 以上になる確率を δ 以下とするためには,

$$n \geq \frac{1}{\varepsilon^2} \frac{p(1-p)}{\delta}$$

とすればよい

疑問

単純なアルゴリズム

硬貨を何度も投げてみる

- ▶ n 回投げるとする (独立な試行)
- ▶ 確率変数 X_i を次で定義 ($i \in \{1, \dots, n\}$) (標示確率変数)

$$X_i = \begin{cases} 1 & (i \text{ 回目に投げたとき表が出る}) \\ 0 & (i \text{ 回目に投げたとき裏が出る}) \end{cases}$$

- ▶ 次の量を出力

$$\frac{X_1 + X_2 + \dots + X_n}{n}$$

疑問

この「単純なアルゴリズム」よりもよいアルゴリズムは無いのか？

目次

- ① 確率の推定：単純なアルゴリズム
- ② 確率の推定：中央値トリック
- ③ 今日のまとめ

中央値トリック (median trick)

中央値トリック

- ▶ n 回投げるとする (独立な試行)
- ▶ $n = (2k - 1)t$ とする (k, t は自然数)
- ▶ 確率変数 X_i を次で定義 ($i \in \{1, \dots, n\}$)

$$X_i = \begin{cases} 0 & (i \text{ 回目に投げたとき裏が出る}) \\ 1 & (i \text{ 回目に投げたとき表が出る}) \end{cases}$$

- ▶ 確率変数 Y_j を次で定義 ($j \in \{1, \dots, 2k - 1\}$)

$$Y_j = \frac{X_{(j-1)t+1} + \dots + X_{(j-1)t+t}}{t}$$

- ▶ 次の量を出力

$$Y = \text{med}\{Y_1, \dots, Y_{2k-1}\}$$

med は中央値 : $\text{med}\{5, 1, 6, 2, 4\} = 4$

中央値トリック：誤差の解析 (1)

- ▶ 次が成り立つために n が満たす条件を見つけない

$$\Pr(|Y - p| \geq \varepsilon) \leq \delta$$

- ▶ 今までの議論から、任意の $j \in \{1, \dots, 2k - 1\}$ に対して

$$\Pr(|Y_j - p| \geq \varepsilon) \leq \frac{1}{\varepsilon^2} \frac{p(1-p)}{t}$$

- ▶ $t \geq \frac{8p(1-p)}{\varepsilon^2}$ とすると、 $\frac{1}{t} \leq \frac{1}{8} \frac{\varepsilon^2}{p(1-p)}$ なので、

$$\Pr(|Y_j - p| \geq \varepsilon) \leq \frac{1}{8}$$

中央値トリック：誤差の解析 (2)

- ▶ このとき，合併上界から

$$\Pr(k \text{ 個の } j \text{ に対して, } |Y_j - p| \geq \varepsilon) \leq \binom{2k-1}{k} \left(\frac{1}{8}\right)^k$$

- ▶ 二項係数に対する上界を用いて，右辺を整理すると

$$\binom{2k-1}{k} \left(\frac{1}{8}\right)^k \leq \left(\frac{e(2k-1)}{k}\right)^k \left(\frac{1}{8}\right)^k < \left(\frac{2e}{8}\right)^k < \left(\frac{3}{4}\right)^k$$

二項係数：簡単な評価

(第1回講義より)

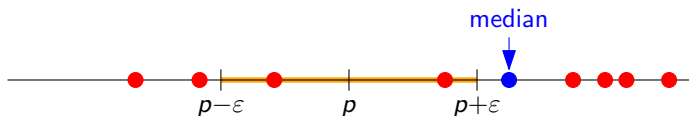
任意の自然数 $a \geq 1$ と任意の自然数 $b \geq 1$ に対して， $a \geq b$ であるとき，

$$\left(\frac{a}{b}\right)^b \leq \binom{a}{b} \leq \left(\frac{ea}{b}\right)^b$$

中央値トリック：誤差の解析 (3)

- ▶ したがって (演習問題 12.3 参照),

$$\begin{aligned} \Pr(|Y - p| \geq \varepsilon) &\leq \Pr(k \text{ 個の } j \text{ に対して, } |Y_j - p| \geq \varepsilon) \\ &< \left(\frac{3}{4}\right)^k \end{aligned}$$



- ▶ $k \geq \log_{3/4} \delta$ とすると

$$\Pr(|Y - p| \geq \varepsilon) < \left(\frac{3}{4}\right)^k \leq \delta$$

中央値トリック：誤差の解析 (まとめ)

中央値トリック：誤差の解析 (まとめ)

- ▶ $t \geq \frac{8p(1-p)}{\varepsilon^2}$, $k \geq \log_{3/4} \delta$ とすると
誤差が ε 以上になる確率を δ 以下にできる
- ▶ このとき、硬貨を投げる回数 n は

$$n = (2k - 1)t \geq \Omega \left(\frac{p(1-p)}{\varepsilon^2} \log \frac{1}{\delta} \right)$$

補足：単純なアルゴリズムにて、硬貨を投げる回数 n は

$$n \geq \frac{p(1-p)}{\varepsilon^2} \frac{1}{\delta}$$

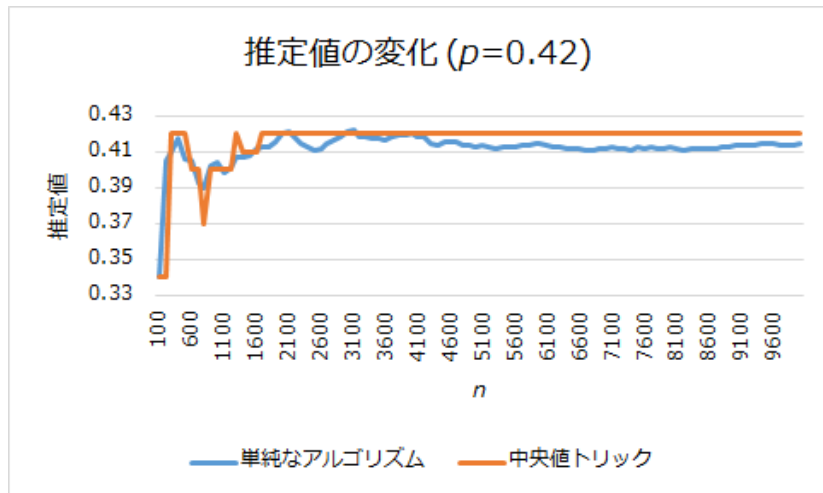
つまり、中央値トリックにより、硬貨を投げる回数が減った

実験してみた

- ▶ パラメータ
 - ▶ $p = 0.42$
 - ▶ $t = 100$
 - ▶ k を変化させることで、 $n = (2k - 1)t$ を変化させる
- ▶ Ruby 2.1.4 で実装
- ▶ n の増加に関する推定値の変化を図示してみた
- ▶ 横軸が n ，縦軸が推定した p の値

注意：このパラメータ設定はとても恣意的なので、他のパラメータ設定で追試をしてみるとよい

実験してみた：結果



中央値トリック：注意

注意

- ▶ 単純なアルゴリズムの出力 X/n に対して，
 $E[X/n] = p$ が成り立つ
- ▶ 中央値トリックの出力 Y に対して，
 $E[Y] = p$ が成り立つ とは限らない

X/n は不偏推定量であるが， Y はそうではない

どういふことか？

- ▶ n を大きくすると， X/n は p に近づいていく
- ▶ n を大きくすると， Y は p の近似値に近づいていく

目次

- ① 確率の推定：単純なアルゴリズム
- ② 確率の推定：中央値トリック
- ③ 今日のまとめ

今日の目標

今日の目標

典型的な乱択アルゴリズムの設計と解析ができるようになる

- ▶ 確率の推定 (中央値トリック)

残った時間の使い方

- ▶ 演習問題をやる
 - ▶ 相談推奨 (ひとりでやらない)
- ▶ 質問をする
 - ▶ 教員と TA は巡回
- ▶ 退室時, 小さな紙に感想など書いて提出する ← 重要
 - ▶ 内容は何でも OK
 - ▶ 匿名で OK

目次

- ① 確率の推定：単純なアルゴリズム
- ② 確率の推定：中央値トリック
- ③ 今日のまとめ