Zufall und Chaos

aus der Sicht der Mathematik

Prof. Dr. Roland Speicher

Universität des Saarlandes



1 / 25

Worüber wollen wir reden

- 1 Die mathematische Bändigung des Zufalls
- 2 Chaos und der Schmetterlingseffekt
- 3 Mathematische Struktur im Chaos
- Qusammenfassung

Section 1

Die mathematische Bändigung des Zufalls

Was ist Zufall?

Deutsches Wörterbuch der Brüder Grimm

"Zufall ist das unberechenbare Geschehen, das sich unserer Vernunft und unserer Absicht entzieht."

Zufall = das, was man nicht vorhersehen kann ...

 radioaktive Zerfall eines Cäsium-Atoms ¹³⁷Cs geschieht zu einer "zufälligen" Zeit

 beim Werfen eines Würfels erhält man "zufällig" eine der Zahlen 1, 2, 3, 4, 5, 6

Zufall = das, was man nicht vorhersehen kann über das man aber trotzdem sehr genaue "statistische" Aussagen machen kann

- \bullet radioaktive Zerfall eines Cäsium-Atoms $^{137}\mathrm{Cs}$ geschieht zu einer "zufälligen" Zeit
 - nach 30 Jahren ist ziemlich genau die Hälfte von einer größeren Menge ¹³⁷Cs zerfallen
- beim Werfen eines Würfels erhält man "zufällig" eine der Zahlen 1, 2, 3, 4, 5, 6
 - bei 1000-maligem Werfen eines Würfels ist die Augensumme aller Würfe recht nahe bei 3.500

Geschichte der Wahrscheinlichkeitstheorie

Einzelne Ereignisse sind zufällig und unvorhersehbar...

- und entziehen sich somit einer wissenschaftlichen Beschreibung
- es gibt keine Anzeichen einer systematischen Theorie des Zufalls im Altertum oder Mittelalter

Von Photograph by Rama, Wikimedia Commons, Cc-by-sa-2.0-fr, CC BY-SA 2.0 fr, https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=11345866

 Aristoteles: der Zufall entzieht sich grundsätzlich der menschlichen Erkenntnis und damit auch der Wissenschaft

6 / 25

Geschichte der Wahrscheinlichkeitstheorie

Einzelne Ereignisse sind zufällig und unvorhersehbar...

- und entziehen sich somit einer wissenschaftlichen Beschreibung
- es gibt keine Anzeichen einer systematischen Theorie des Zufalls im Altertum oder Mittelalter

Von Photograph by Rama, Wikimedia Commons, Cc-by-sa-2.0-fr, CC BY-SA 2.0 fr, https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=11345866

 Aristoteles: der Zufall entzieht sich grundsätzlich der menschlichen Erkenntnis und damit auch der Wissenschaft

... aber viele solcher Ereignisse zeigen eine Struktur und sind mathematischen Untersuchungen zugänglich

- Gerolamo Cardano: Liber de Ludo Aleae (Buch vom Würfelspiel), 1524
- Briefwechsel zwischen Blaise Pascal und Pierre Fermat, 1654
- Johan de Witt: Wert von Leibrenten im Vergleich zu Anleihen, 1671

Gerolamo Cardano (1501 – 1576)

- Universalgelehrter der Renaissance
- Kardangelenk = Kreuzgelenk
- Liber de Ludo Alea = Buch der Glücksspiele





entstanden ab 1524, aber erst 1663 posthum veröffentlicht

Briefwechsel zwischen Pascal und Fermat 1654

- Blaise Pascal (1623 1662): französischer Mathematiker, Physiker, Literat, christlicher Philosoph
- Pierre Fermat (1607 1665): französischer Mathematiker und Jurist;
 einer der bedeutensten Mathematiker seiner Zeit

8 / 25

Briefwechsel zwischen Pascal und Fermat 1654

- Blaise Pascal (1623 1662): französischer Mathematiker, Physiker, Literat, christlicher Philosoph
- Pierre Fermat (1607 1665): französischer Mathematiker und Jurist;
 einer der bedeutensten Mathematiker seiner Zeit
- Briefwechsel zwischen Pascal und Fermat 1654 gilt als Geburtsstunde der Wahrscheinlichkeitstheorie

Briefwechsel zwischen Pascal und Fermat 1654

- Blaise Pascal (1623 1662): französischer Mathematiker, Physiker, Literat, christlicher Philosoph
- Pierre Fermat (1607 1665): französischer Mathematiker und Jurist; einer der bedeutensten Mathematiker seiner Zeit
- Briefwechsel zwischen Pascal und Fermat 1654 gilt als Geburtsstunde der Wahrscheinlichkeitstheorie
- behandelt zwei von Chevalier de Méré an Pascal gestellte Probleme:
 - das Problem der Würfel
 - das Problem der Gewinnaufteilung

8 / 25

 Man wirft einen Würfel 4 Mal. Lohnt es sich, darauf Geld zu wetten, dass dabei mindestens einmal eine Sechs kommt?



 Man wirft einen Würfel 4 Mal. Lohnt es sich, darauf Geld zu wetten, dass dabei mindestens einmal eine Sechs kommt?



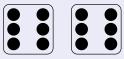
$$P(\mathrm{mind.\ eine\ Sechs}) = 1 - P(\mathrm{keine\ Sechser}) = 1 - \left(\frac{5}{6}\right)^4 \approx 52\%$$

 Man wirft einen Würfel 4 Mal. Lohnt es sich. darauf Geld zu wetten, dass dabei mindestens einmal eine Sechs kommt? IΔI



$$P({\rm mind.~eine~Sechs}) = 1 - P({\rm keine~Sechser}) = 1 - \left(\frac{5}{6}\right)^4 \approx 52\%$$

 Man wirft ein Paar Würfel 24 Mal. Lohnt es sich, darauf Geld zu wetten, dass dabei mindestens einmal eine Doppel-Sechs kommt?



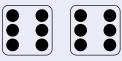


 Man wirft einen Würfel 4 Mal. Lohnt es sich. darauf Geld zu wetten, dass dabei mindestens einmal eine Sechs kommt? JA!



$$P(\text{mind. eine Sechs}) = 1 - P(\text{keine Sechser}) = 1 - \left(\frac{5}{6}\right)^4 \approx 52\%$$

 Man wirft ein Paar Würfel 24 Mal. Lohnt es sich, darauf Geld zu wetten, dass dabei mindestens einmal eine Doppel-Sechs kommt?



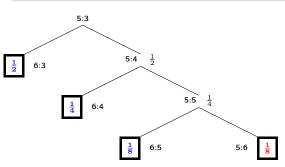


$$P({\rm mind.\ Doppelsechs}) = 1 - P({\rm keine\ Doppelsechser}) = 1 - \left(\frac{35}{36}\right)^{24} pprox 49\%$$

• In jeder Runde wird eine Münze geworfen. Es wird so lange gespielt, bis einer der beiden Spieler 6 Mal gewonnen hat. Derjenige, der zuerst 6 Mal gewonnen hat, bekommt das Preisgeld.

- In jeder Runde wird eine Münze geworfen. Es wird so lange gespielt, bis einer der beiden Spieler 6 Mal gewonnen hat. Derjenige, der zuerst 6 Mal gewonnen hat, bekommt das Preisgeld.
- Auf Grund höherer Gewalt muss das Spiel jedoch vor der Entscheidung beim Stande von 5:3 unerwartet abgebrochen werden. Wie soll das Preisgeld in dem Fall gerecht verteilt werden?

- In jeder Runde wird eine Münze geworfen. Es wird so lange gespielt, bis einer der beiden Spieler 6 Mal gewonnen hat. Derjenige, der zuerst 6 Mal gewonnen hat, bekommt das Preisgeld.
- Auf Grund höherer Gewalt muss das Spiel jedoch vor der Entscheidung beim Stande von 5:3 unerwartet abgebrochen werden. Wie soll das Preisgeld in dem Fall gerecht verteilt werden?

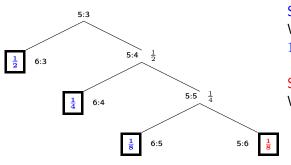


Spieler 1 gewinnt mit Wahrscheinlichkeit: 1/2 + 1/4 + 1/8 = 7/8

Spieler 2 gewinnt mit Wahrscheinlichkeit: 1/8

Roland Speicher Zufall und Chaos 10 / 25

- In jeder Runde wird eine Münze geworfen. Es wird so lange gespielt, bis einer der beiden Spieler 6 Mal gewonnen hat. Derjenige, der zuerst 6 Mal gewonnen hat, bekommt das Preisgeld.
- Auf Grund höherer Gewalt muss das Spiel jedoch vor der Entscheidung beim Stande von 5:3 unerwartet abgebrochen werden. Wie soll das Preisgeld in dem Fall gerecht verteilt werden?



Spieler 1 gewinnt mit Wahrscheinlichkeit: 1/2 + 1/4 + 1/8 = 7/8

Spieler 2 gewinnt mit Wahrscheinlichkeit: 1/8

deshalb: Aufteilung 7:1

10 / 25

Normal- (oder Gauß-) Verteilung



11 / 25

Normal- (oder Gauß-) Verteilung



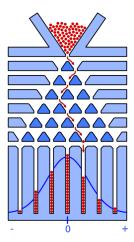


- Frauen → Männer

Von IchBinEuerHeld, statista.org, SOEP - SOEP & statista.org, https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=57191516

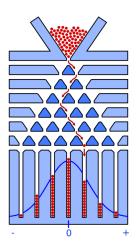
Roland Speicher Zufall und Chaos 11 / 25

Zentraler Grenzwertsatz: Die Überlagerung einer großen Zahl von unabhängigen Einflüssen ist annäherend normalverteilt.



Galton-Brett

Zentraler Grenzwertsatz: Die Überlagerung einer großen Zahl von unabhängigen Einflüssen ist annäherend normalverteilt.





Matemateca (IME/USP)/Rodrigo Tetsuo Argenton, CC-BY-SA 4.0, https://commons.wikimedia.org/w/index.php?curid=57045935

Galton-Brett

"Zufall" wird mathematisch dadurch gezähmt, dass wir ...

- über Wahrscheinlichkeiten von Ereignissen reden
- Rechenregeln für diese Wahrscheinlichkeiten von Ereignissen haben

Roland Speicher Zufall und Chaos 13 / 25

"Zufall" wird mathematisch dadurch gezähmt, dass wir ...

- über Wahrscheinlichkeiten von Ereignissen reden
- Rechenregeln für diese Wahrscheinlichkeiten von Ereignissen haben

Aber was "bedeutet" die Wahrscheinlichkeit eines Ereignisses?

 frequentistischer (objektiver) Wahrscheinlichkeitsbegriff: wird das gleiche Experiment (unendlich) oft durchgeführt, so ist

 $Wahrscheinlichkeit = \frac{\mathsf{Anzahl} \ \mathsf{der} \ \mathsf{Versuche}, \ \mathsf{bei} \ \mathsf{denen} \ \mathsf{Ereignis} \ \mathsf{eintritt}}{\mathsf{Anzahl} \ \mathsf{aller} \ \mathsf{Versuche}}$

 Bayesscher (subjektiver) Wahrscheinlichkeitsbegriff:
 Wahrscheinlichkeit ist ein Maß dafür, wie stark man von dem Eintreten des Ereignisses überzeugt ist

13 / 25

... und wie kommt der Zufall in die reale Welt?

- Quantenzufall
- Unkenntnis der Anfangsbedingungen
- Sensitivität gegenüber kleinen Abweichungen bei Anfangsbedingungen

Section 2

Chaos und der Schmetterlingseffekt

Henri Poincaré (1854 – 1920)



- bedeutender französischer Mathematiker, theoretischer Physiker, theoretischer Astronom und Philosoph;
- einer der bedeutensten Mathematiker seiner Zeit (vergleichbar mit Hilbert in Deutschland)
- Cousin von Raymond Poincare = Ministerpräsident und Staatspräsident von Frankreich um 1920

"Eine sehr kleine Ursache, die uns entgehen mag, bewirkt einen beachtlichen Effekt, den wir nicht ignorieren können, und dann sagen wir, dass dieser Effekt auf Zufall beruht."

Kleine Ursachen haben grosse Wirkungen

... sprichwörtlich ...

- Türkisches Sprichwort
 "Ein Nagel kann ein Hufeisen retten, ein Hufeisen ein Pferd, ein Pferd einen Reiter und ein Reiter ein Land."
- Chinesisches Sprichwort "Weil ein Nagel verloren ging, ging das Hufeisen verloren. Weil das Hufeisen verloren ging, ging auch das Pferd verloren. Weil das Pferd verloren ging, ging auch der Reiter verloren. Weil der Reiter verloren ging, konnte die Nachricht nie übermittelt werden. Und weil die Nachricht nie übermittelt werden konnte, wurde der Krieg verloren."

Kleine Ursachen haben grosse Wirkungen

... insbesondere Schmetterlinge ...

Philipp Bradbury: A Sound of Thunder (Ferner Donner), 1952



Das versehentliche Zertreten eines Schmetterlings auf einer Zeitreise in die Vergangenheit bei einer Dinosaurier-Safari ändert die Gegenwart (von einer demokratischen in eine totalitär regierte Welt)

Kleine Ursachen haben grosse Wirkungen

... insbesondere Schmetterlinge ...

• Philipp Bradbury: A Sound of Thunder (Ferner Donner), 1952



Das versehentliche Zertreten eines Schmetterlings auf einer Zeitreise in die Vergangenheit bei einer Dinosaurier-Safari ändert die Gegenwart (von einer demokratischen in eine totalitär regierte Welt)

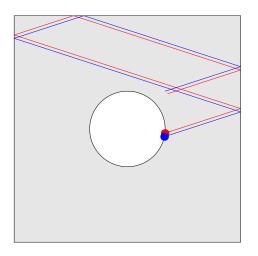
Edward N. Lorenz: Butterfly Effect (Schmetterlingseffekt), 1972

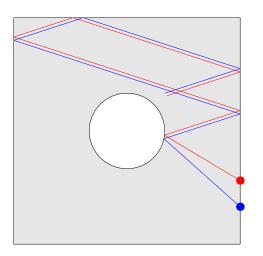


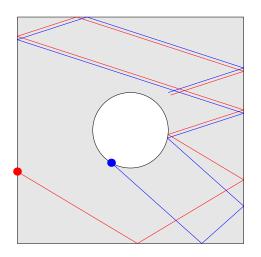
"Predictability: Does the Flap of a Butterfly's Wings in Brazil set off a Tornado in Texas?" "Kann der Flügelschlag eines Schmetterlings in

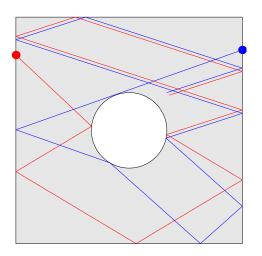
Brasilien einen Tornado in Texas auslösen?"

By User:Wikimol, User:Dschwen, CC-BY-SA-3.0

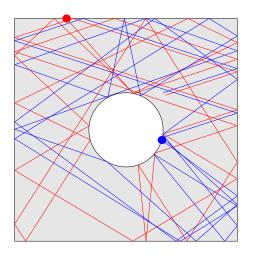








Kleine Ursachen haben große Wirkungen – allerdings oft unvorhersehbare



Deterministische Systeme zeigen chaotisches Verhalten

Beispiele

- "einfache" klassische mechanische Systeme
 - Billard (Hadamard 1898, Sinai 1970)
 - Dreikörperproblem: Sonne, Erde, Mond (Poincarè 1890)
 - Doppelpendel
- Wettervorhersage (Edward Lorenz 1972, "seltsamer Attraktor")
- Populationsdynamik, logistisches Wachstums (Robert May 1976)

Deterministische Systeme zeigen chaotisches Verhalten

Beispiele

- "einfache" klassische mechanische Systeme
 - Billard (Hadamard 1898, Sinai 1970)
 - Dreikörperproblem: Sonne, Erde, Mond (Poincarè 1890)
 - Doppelpendel
- Wettervorhersage (Edward Lorenz 1972, "seltsamer Attraktor")
- Populationsdynamik, logistisches Wachstums (Robert May 1976)

Diese Systeme sind nicht nur sehr schwierig langfristig vorherzusagen, sondern es ist hoffnungslos nach einer exakten Lösung zu suchen.

Deterministische Systeme zeigen chaotisches Verhalten ... aber auch Chaos zeigt Struktur

Beispiele

- "einfache" klassische mechanische Systeme
 - Billard (Hadamard 1898, Sinai 1970)
 - Dreikörperproblem: Sonne, Erde, Mond (Poincarè 1890)
 - Doppelpendel
- Wettervorhersage (Edward Lorenz 1972, "seltsamer Attraktor")
- Populationsdynamik, logistisches Wachstums (Robert May 1976)

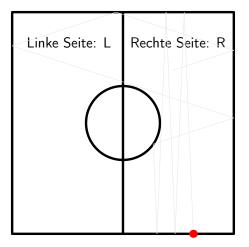
Diese Systeme sind nicht nur sehr schwierig langfristig vorherzusagen, sondern es ist hoffnungslos nach einer exakten Lösung zu suchen.

Allerdings:

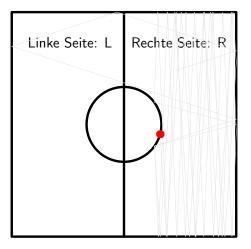
Chaotische Systeme (in obigen deterministischen Sinne) sind nicht total willkürlich, sondern haben berechenbare statistische Eigenschaften.

Section 3

Mathematische Struktur im Chaos

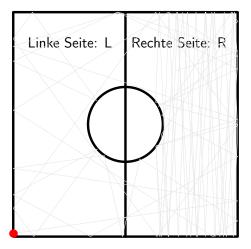


Trajektorie der Billardkugel: R

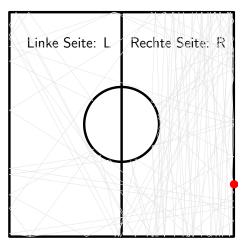


Trajektorie der Billardkugel: RR

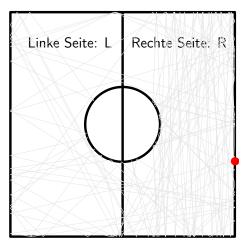
22 / 25



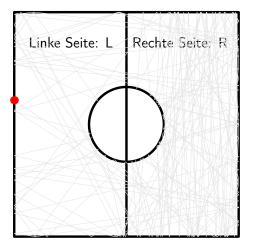
Trajektorie der Billardkugel: RRL



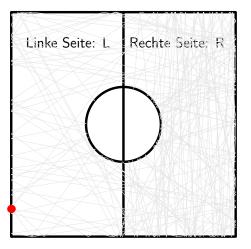
Trajektorie der Billardkugel: RRLR



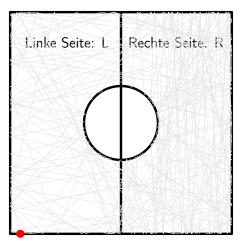
Trajektorie der Billardkugel: RRLRR



Trajektorie der Billardkugel: RRLRRL

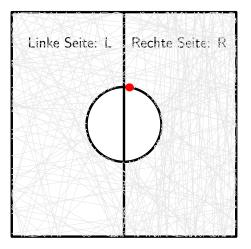


Trajektorie der Billardkugel: RRLRLL



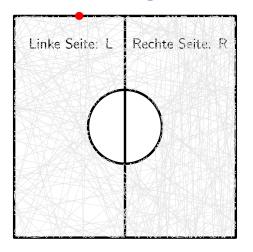
Trajektorie der Billardkugel: RRLRRLLL

Roland Speicher Zufall und Chaos 22 / 25

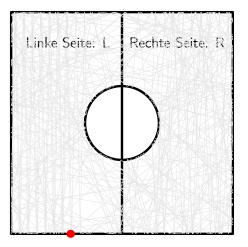


Trajektorie der Billardkugel: RRLRRLLR

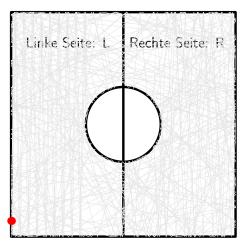
Roland Speicher Zufall und Chaos 22 / 25



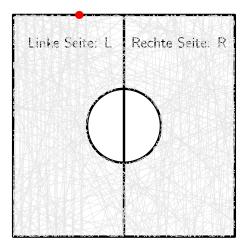
Trajektorie der Billardkugel: RRLRRLLRL



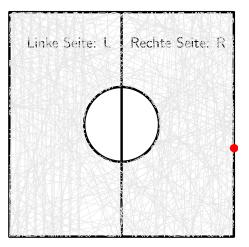
Trajektorie der Billardkugel: RRLRRLLRL



Trajektorie der Billardkugel: RRLRRLLL



Trajektorie der Billardkugel: RRLRRLLLL



Trajektorie der Billardkugel: RRLRRLLLRLLR ...

• Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

 $RRLRRLLLRLLLR \cdots$

beschrieben werden.

Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

$$RRLRRLLLRLLLLR \dots$$

beschrieben werden.

• Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

R



Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

$$RRLRRLLLRLLLLR \cdots$$

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

R





Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

$$RRLRRLLLRLLLLR \cdots$$

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

R R L







Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

$$RRLRRLLLRLLLLR \cdots$$

beschrieben werden

• Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

R I R R









Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

$$RRLRRLLLRLLLLR \cdots$$

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

RRLRR









Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

$$RRLRRLLLRLLLR \cdots$$

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

RRLRRL













Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

$$RRLRRLLLRLLLR \cdots$$

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

RRLRRLL

















Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

RRLRRLLL



















Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

$$RRLRRLLLRLLLLR \dots$$

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

RRLRRLLLR























• Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

RRLRRLLR























• Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

RRLRRLLRLL

























Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

beschrieben werden

• Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

IIIRII R R































Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

beschrieben werden

• Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:



































• Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

 $RRLRRLLLRLLLLR \dots$

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

































Deterministisches Chaos zeigt Struktur – und verhält sich auf lange Sicht wie eine Serie zufälliger Münzwürfe

• Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

RRLRRLLLRLLLLR...

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:



 Bezüglich dieser Beschreibung sind deterministische Trajektorien und zufällige Münzwürfe nicht zu unterscheiden

Deterministisches Chaos zeigt Struktur – und verhält sich auf lange Sicht wie eine Serie zufälliger Münzwürfe

• Trajektorie der Billardkugel kann durch Symbolfolge

 $RRLRRLLLRLLLLR \cdots$

beschrieben werden.

 Diese Symbolfolge kann aber auch als Ergebnis einer Reihe von Münzwürfen angesehen werden:

- Bezüglich dieser Beschreibung sind deterministische Trajektorien und zufällige Münzwürfe nicht zu unterscheiden
- deterministisches Chaos ist Zufall

Roland Speicher Zufall und Chaos 23 / 25

Section 4

Zusammenfassung

Schmetterlingseffekt

 deterministische Systeme zeigen oft Sensitivität gegenüber kleinen Änderungen in den Anfangsbedingungen ("Schmetterlingseffekt")

Schmetterlingseffekt ergibt Chaos

- deterministische Systeme zeigen oft Sensitivität gegenüber kleinen Änderungen in den Anfangsbedingungen ("Schmetterlingseffekt")
- ihr Verhalten wird dann unberechenbar und chaotisch

Schmetterlingseffekt ergibt Chaos ergibt Zufall

- deterministische Systeme zeigen oft Sensitivität gegenüber kleinen Änderungen in den Anfangsbedingungen ("Schmetterlingseffekt")
- ihr Verhalten wird dann unberechenbar und chaotisch
- dieses Chaos ist aber nicht total chaotisch, sondern "zufällig"

Schmetterlingseffekt ergibt Chaos ergibt Zufall

- deterministische Systeme zeigen oft Sensitivität gegenüber kleinen Änderungen in den Anfangsbedingungen ("Schmetterlingseffekt")
- ihr Verhalten wird dann unberechenbar und chaotisch
- dieses Chaos ist aber nicht total chaotisch, sondern "zufällig"
- Zufall ist mathematisch beschreibbar

Schmetterlingseffekt ergibt Chaos ergibt Zufall

- deterministische Systeme zeigen oft Sensitivität gegenüber kleinen Änderungen in den Anfangsbedingungen ("Schmetterlingseffekt")
- ihr Verhalten wird dann unberechenbar und chaotisch
- dieses Chaos ist aber nicht total chaotisch, sondern "zufällig"
- Zufall ist mathematisch beschreibbar
- und erlaubt insbesondere statistische Aussagen

Schmetterlingseffekt ergibt Chaos ergibt Zufall

- deterministische Systeme zeigen oft Sensitivität gegenüber kleinen Änderungen in den Anfangsbedingungen ("Schmetterlingseffekt")
- ihr Verhalten wird dann unberechenbar und chaotisch
- dieses Chaos ist aber nicht total chaotisch, sondern "zufällig"
- Zufall ist mathematisch beschreibbar
- und erlaubt insbesondere statistische Aussagen



Vielen Dank!



Justin1569 at English Wikipedia, CC-BY-SA-3.0