

La matrice magique de Markov

Soit M , la matrice de transition entre deux états de distribution des probabilités. Si la distribution des probabilités à un moment du jeu est donnée par une colonne de 40 nombres, la distribution des probabilités après un jet de dé est donnée par le produit de la matrice M par cette colonne. Nous calculerons tout d'abord un ensemble de 40 nombres nommés valeurs propres de M . Un nombre m est une valeur propre de M si l'on peut écrire une colonne de 40 nombres, nommée vecteur propre, telle que si l'on multiplie la matrice M à cette colonne, on retrouve la colonne initiale multipliée par le nombre m . Comme cette matrice possède une structure particulière (voir la figure 3), on peut effectuer sa multiplication avec la colonne sans connaître l'algèbre ! Écrivons chaque nombre de la colonne sur les 40 cases de la représentation mathématique du jeu. La multiplication de la matrice par la colonne est obtenue en séparant chaque nombre en six parties égales que l'on place parmi les six cases suivantes. Le problème est que les valeurs propres ne sont pas nécessairement des réels compris entre 0 et 1 : elles peuvent être des nombres complexes, de la forme $a + ib$, avec $i^2 = -1$.

Lorsque les 40 valeurs propres sont déterminées, il ne reste qu'à trouver la plus grande (en module, en raison du caractère complexe de certaines valeurs propres). La dis-

tribution des probabilités sera alors approchée d'aussi près que l'on voudra par le vecteur propre correspondant «normalisé», c'est-à-dire tel que la somme de ses composantes soit égale à 1, comme toute probabilité qui se respecte. Il suffit pour cela de diviser chaque composante par la somme de toutes les autres.

En raison des symétries de la matrice, il est relativement aisé de déterminer les valeurs propres, et donc les vecteurs propres. Un de ces vecteurs propres a toutes ses composantes égales à $1/40$: quelle est la valeur propre associée ? Supposons que nous partions de cette distribution des probabilités : la probabilité de tomber sur n'importe quelle case du plateau de jeu est égale à $1/40$. Pour chaque case, partageons alors $1/40$ en 6 parties égales, soit $1/240$, et plaçons $1/240$ sur les six cases suivantes. Chaque case recevra alors exactement six contributions égales dont la somme sera $6 \times 1/240$, soit $1/40$. La valeur propre associée est donc égale à 1. Je n'explicitai pas les 39 autres valeurs propres, dont les expressions sont superbes (du moins pour le mathématicien !). Hormis la valeur propre égale à 1, la deuxième valeur propre dans l'ordre décroissant est égale à 0,964..., de sorte que 1 est celle de plus grand module et son vecteur propre représente l'état à long terme de la distribution des probabilités.

ment, nous allons simplifier le problème. Au lieu de considérer le jet simultané des deux dés, nous imaginerons que les dés sont lancés l'un après l'autre. Chaque joueur jette donc les dés en deux coups : un coup fantôme, pour lequel il ne tient pas compte de la case où il atterrit, et un coup réel. De surcroît, nous représenterons le plateau de jeu comme un cercle (voir la figure 1).

Par commodité, numérotions les cases de 0 à 39, la case 40 coïncidant avec la case 0, la case «Départ». Nous considérerons ces nombres comme des

entiers modulo 40 : tout entier supérieur à 39 est remplacé par le reste de la division de cet entier par 40. Imaginons à présent un unique joueur qui effectue des jets successifs d'un dé unique et se qui se déplace en conséquence. Quelle est alors la probabilité de tomber sur une case donnée après un nombre donné de jets ? Pour chaque case, on espère que, lorsque le nombre de jets croît, cette probabilité s'approche de $1/40$. En d'autres termes, les événements «atterrir sur une case du plateau de jeu» devraient devenir équiprobables.

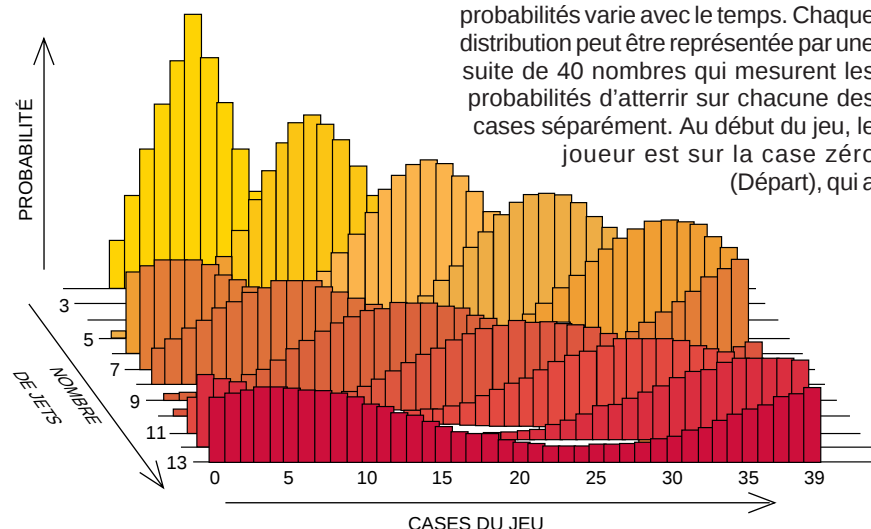
Étudions comment la distribution des probabilités varie avec le temps. Chaque distribution peut être représentée par une suite de 40 nombres qui mesurent les probabilités d'atterrir sur chacune des cases séparément. Au début du jeu, le joueur est sur la case zéro (Départ), qui a

donc la probabilité 1. La distribution des probabilités est donc 1 pour la case «Départ», puis des zéros pour les 39 cases suivantes. Après un premier jet fantôme, la distribution devient 0, $1/6$, $1/6$, $1/6$, $1/6$, $1/6$, 0, ..., 0 : la probabilité d'atterrir sur les cases numérotées de 1 à 6 est égale à $1/6$, et les autres cases sont inaccessibles.

LA RÉPARTITION DES PROBABILITÉS

Notez que la probabilité totale 1, d'abord concentrée sur la case 0, s'est répartie en six parties égales, sur les cases 1 à 6. C'est le mécanisme général : après chaque jet de dé, la probabilité de tomber sur chaque case est divisée en six parties égales, qui sont distribuées aux six cases qui la suivent. Ainsi, au deuxième jet, la probabilité de $1/6$ de la case 1 est redistribuée comme suit : 0, 0, $1/36$, $1/36$, $1/36$, $1/36$, $1/36$, $1/36$, 0, ..., 0. Les probabilités de $1/6$ des cases 2 à 6 sont de même redistribuées, après décalage d'une case à chaque étape.

Finalement, on ajoute sur chaque case les redistributions des cases précédentes. Par exemple, la case 6 reçoit $1/36$ de chacune des cases 1 à 5 et 0 de la dernière, d'où un total de $5/36$. La distribution après le deuxième jet de dé est : 0, 0, $1/36$, $2/36$, $3/36$, $4/36$, $5/36$, $6/36$, $5/36$, $4/36$, $3/36$, $2/36$, $1/36$, 0, ..., 0. Nous retrouvons là notre évaluation initiale pour un jet à deux dés. Poursuivons avec le troi-



2. L'évolution de la répartition de probabilité sur les 40 cases du jeu est représenté au cours de 13 jets de dé. La hauteur de chaque rectangle indique la probabilité d'atterrir sur la case correspondante.