

УДК 530.1

З.Ж. Жанабаев

Казахский национальный университет им. аль-Фараби, Казахстан, г. Алматы
E-mail: kazgu.kz@gmail.com

Критерии самоподобия и самоаффинности динамического хаоса

Работа посвящена выяснению вопроса: существуют ли количественные критерии реализации универсального явления самоорганизации в открытых системах? Самоорганизацию также называют возникновением порядка из хаоса при выполнении условий нелинейности, неравновесности, незамкнутости.

В настоящей работе определены значения информации в неподвижных точках функции плотности вероятности реализации информации I_1 и энтропии I_2 . Раскрыт смысл этих величин в виде критериев самоаффинности и самоподобия хаотических процессов, энтропии Колмогорова – Синяя, фрактальных размерностей соответствующих масштабно-инвариантных множеств.

Показано, что самоорганизация имеет место, если нормированная на единицу информационная энтропия S принимает значения в интервале $I_1 \leq S \leq I_2$, где $I_1 = 0.567$, $I_2 = 0.806$. Правомерность этих выводов доказана вычислением S для известных фракталов и указаны возможные приложения результатов в современных отраслях науки и техники.

Ключевые слова: информация, энтропия, фрактал, хаос, самоорганизация.

Z.Zh. Zhanabayev

Criteria of self-similarity and self-affinity of dynamical chaos

This work is devoted to study out the following question: does any qualitative criteria of realization of such universal phenomena as self-organization exist in open systems? Self-organization is also called the appearance of order from chaos under the conditions of non-linearity, non-equilibrium and non closure. Information entropy and fractal dimension of a set of physical values are usually used as quantitative characteristics of chaos. The more detailed characteristic of dynamical chaos is the Kolmogorov-Sinay entropy. Inhomogeneity of elements of a phase space can be taken into account by use of this characteristic. Technically, precise calculation of Kolmogorov – Sinay entropy can't be realized. Uncertain questions are: What is the minimum of increasing of entropy, how much it decreases at self-organization? Also it was not ascertained the connection between entropy criterion of self-similarity and self-affine with fractal dimensions characterized corresponding chaotic processes.

In the paper the values of information at fixed points of probability function of density of information I_1 and entropy I_2 have been defined. Physical meaning of these values as criteria of self-affinity and self-similarity in chaotic processes have been explained. The Kolmogorov-Sinay entropy and fractal dimensions corresponding to scale-invariant sets have been described also.

It is shown that self-organization occurs when normalized information entropy Stakes values in the interval $I_1 \leq S \leq I_2$, where $I_1 = 0.567$, $I_2 = 0.806$. The precision of these findings is proved by calculation the value S . Applications of these results in modern scientific and engineering areas are possible.

Keywords: information, entropy, fractal, chaos, self-organization.

З.Ж. Жаңабаев

Динамикалық хаостың өзқас және өзэффиндік критерийлері

Жұмыс мына сұрақты талқылауға арналған: ашық жүйелерде байқалатын әмбебап өзқауым құбылысының болуының сандық белгі-шарттары бар ма? Өзқауым құбылысын бейсызықтық, тепе-теңсіздік, тұйықталмағандық орындалғанда хаостан тәртіптің пайда болуы деп те қарастырады. Хаостың сандық сипаттамалары ретінде, әдетте, физикалық шаманың мәндері жиынының информациялық энтропиясын және фракталдық өлшемділіктерін қолданады. Динамикалық хаостың дәлірек сипаттамасы болып Колмогоров – Синай энтропиясы табылады, бұл шама фазалық кеңістік элементтерінің әртектілігін ескереді.

Алайда Колмогоров – Синай энтропиясын дәл есептеудің техникалық қиындықтары бар және мына сұрақтар жауапсыз қалуда: өзқауым кезінде энтропияның ең аз өзгерісі қандай, ол қаншалықты азаяды? Сонымен қатар хаосты сипаттайтын энтропиялық өзқасстық және өзэффиндік белгі-шарттардың осы процестерге сәйкес фракталдық өлшемділіктермен байланысы белгісіз. Бұл жұмыста информацияның байқалу ықтималдығының тығыздық функциясының (I_1) және информациялық энтропияның (I_2) қозғалмайтын нүктелері анықталған. Бұл шамалардың мағынасы хаосты процестердің өзэффиндік, өзқасстық белгі-шарттары және сәйкес фракталдық өлшемділіктері ретінде қарастырылған.

Егер бірлікке нормаланған информациялық энтропияның мәндері $I_1 \leq S \leq I_2$, ($I_1 = 0.567$; $I_2 = 0.806$) интервалында жатса, өзқауым процесі байқалатындығы көрсетілген. Бұл қорытындылардың дұрыстығы белгілі модельдік фракталдардың бір буындарының S энтропиясын есептеу арқылы дәлелденген. S шамасын нормалаудың жолдары және алынған нәтижелердің қазіргі ғылым мен техниканың салаларында қолдану мүмкіндіктері көрсетілген.

Түйін сөздер: информация, энтропия, фрактал, хаос, өзқауым.

Введение

Дальнейшее развитие современных технологий нуждается в знании физических закономерностей, например, наноструктур, сверхвысокочастотных (гигагерцовых) хаотических сигналов, ансамбля нейронных сетей. Несмотря на разнообразную сложность перечисленных объектов и процессов, у них может проявляться единое общее свойство – масштабная инвариантность. Это означает отсутствие необходимости в параметрах с размерностью, например, длины. Масштабная инвариантность проявляется в виде самоподобия (коэффициенты подобия одинаковы по всем переменным) и самоэффинности (коэффициенты подобия различны по разным переменным). Общее название процессов различной природы с такими свойствами – самоорганизация материи и ее движения. Теорию самоорганизации называют синергетикой.

Самоорганизацию также называют возникновением порядка из хаоса при выполнении

условий нелинейности, неравновесности, незамкнутости. Поэтому для простоты мы будем говорить об инвариантных свойствах хаотических процессов.

В качестве количественных характеристик хаоса обычно используют информационную энтропию и фрактальную размерность множества значений физических величин. Более детальной характеристикой динамического хаоса является энтропия Колмогорова – Синай, учитывающая неоднородность элементов фазового пространства. Известная теорема И. Пригожина утверждает, что при самоорганизации производная энтропии по времени стремится к минимуму. По теореме Ю.Климонтовича [1] при самоорганизации энтропия уменьшается, если сравнение произвести при одинаковых значениях энергии.

Однако непосредственный точный расчет энтропии Колмогорова – Синай технически не реализуется, упомянутые теоремы не отвечают на вопросы: каков минимальный прирост эн-

тропии, насколько она уменьшается при самоорганизации? Также не выяснена связь между энтропийными критериями самоподобия и самоаффинности с фрактальными размерностями, характеризующими соответствующие хаотические процессы. Целью настоящей работы является поиск ответов на эти вопросы.

Информационные критерии масштабной инвариантности

Понятие информации широко используется в кибернетике, генетике, социологии. Развитие синергетики, физики открытых систем требует универсального определения информации, пригодного для использования в различных отрас-

лях науки. Само определение открытой системы содержит понятие информации: открытой системой называется система, обменивающаяся с внешней средой веществом, энергией, информацией.

Обычно определение сложного понятия формируется через перечень его основных свойств. Информация $I(x)$ статистической реализации некоторой физической величины x является положительной величиной и определена при наличии неравновесности $I(x) \neq I(x_0)$, если $x \neq x_0$. Если $P(x)$ является вероятностью появления величины x , то выражение для количества информации

$$I(x) = -\ln P(x) \quad (1)$$

описывает эти свойства. Повторяемость и неравновесность процесса учитывается условием $0 < P(x) < 1$. С точки зрения различных наук предложено много определений информации.

Формула (1) совместима со всеми этими определениями.

При наличии некоторого условия u информацию определяют через разность безусловной и условной энтропий:

$$I(x|y) = S(x) - S(x|y). \quad (2)$$

Эта формула используется для технических задач, например, для оценки пропускной способности каналов связи. Однако, сама инфор-

мационная энтропия $S(x)$ является средним значением информации:

$$S(x) = \sum_i P_i(x) I_i(x) = - \sum_i P_i(x) \ln P_i(x), \quad (3)$$

где i – номер ячеек разбиения множества значений x . Поэтому формулу (1) мы примем за основное определение информации.

Таким образом, хотя нет универсального определения информации, она используется для описания явлений различной природы. Поэтому возможен другой новый подход к теории информационно-явлений. Можно принять за

определенную независимую переменную саму информацию. Выражая статистические характеристики процесса через информацию, можно искать новые свойства информации, например, масштабно – инвариантные свойства.

После этого можно говорить о вероятности реализации информации $P(I)$ согласно формуле (1):

$$P(I) = e^{-I}. \quad (4)$$

Для плотности вероятности $f(I)$ имеем формулы

$$0 \leq P(I) \leq 1, 0 \leq I \leq \infty, \int_0^{\infty} f(I) dI = 1, P(I) = \int_0^{\infty} f(I) dI, f(I) = P(I) = e^{-I}. \quad (5)$$

Функция вероятности реализации информации $P(I)$ совпадает с функцией распределения плотности вероятности $f(I)$. Именно информация, определенная по формуле (1), обладает масштабной

инвариантностью: часть и целое имеют одинаковый закон распределения. Информационную энтропию распределения значений информации $S(I)$ определяем как среднее значение информации:

$$S(I) = \int_0^{\infty} I f(I) dI = (1 + I)e^{-I}. \tag{6}$$

Для $0 \leq I \leq \infty$ имеем $1 \geq S \geq 0$, т.е. энтропия нормирована на единицу. Известно, что энтропия непрерывного множества при скачкообразном изменении переменных бесконечна и поэтому интеграл вычисляется в смысле Лебега путем введения некоторой меры. В качестве меры

мы приняли саму информацию и получили результат (6).

Воспользуемся известным функциональным уравнением, которому удовлетворяет некоторая характерная функция $g(x)$ с масштабно – инвариантным свойством:

$$g(x) = \alpha g(g(x) \alpha), \tag{7}$$

где α – масштабный множитель. Любая непрерывная функция в своей неподвижной точке удовлетворяет уравнению (7). Принимая в каче-

стве характерных функций $f(I)$ и $S(I)$, определим их неподвижные точки:

$$f(I) = I, e^{-I} = I, I = I_1 = 0.567, \tag{8}$$

$$S(I) = I, 1 + I e^{-I} = I, I = I_2 = 0.806. \tag{9}$$

Эти неподвижные точки являются единственно устойчивыми, так как они являются также и преде-

лами бесконечных отображений, достигаемых при любых начальных значениях I_0 :

$$I_{i+1} = f(I_i), \lim_{i \rightarrow \infty} \exp(-\exp \dots - \exp I_0 \dots) = I_1, \tag{10}$$

$$I_{i+1} = S(I_i), \lim_{i \rightarrow \infty} \exp(-\exp \dots - \exp \ln I_0 + 1 - I_0 \dots) = I_2, \tag{11}$$

где число скобок равно $i + 1$.

Возможны различные толкования физического смысла чисел $I_1 = 0.567$, $I_2 = 0.806$. Плотность вероятности является локальной (мгновенной) характеристикой, поэтому она может быть различной по разным переменным и число I_1 можно принять за критерий самоаффинности. Энтропия – усредненная характери-

стика, поэтому число I_2 является критерием самоподобия.

С другой стороны, числа I_1, I_2 могут быть рассмотрены как аналоги числа Фиббоначчи $I_{20} = 0.618$ (“золотого сечения” динамической меры), соответственно, для статистических самоаффинных и самоподобных систем. Действительно, из формулы (9) при $I \lesssim 1$ имеем

$$1 + I - I^2 = I, I^2 + I - 1 = 0, I = I_{20} = 0.618, \tag{12}$$

также при $l \ll 1$ из (9) имеем $e^{-l} = l$, $l = I_1$. Мы видим, что закономерности подобия самоаффинности, динамического равновесия, самоподобия систем описываются одной формулой (9).

Энтропия Колмогорова – Синая фрактальных множеств

Пусть $x(t) = x_1(t), \dots, x_m(t)$ – траектория динамической системы на странном (фрактальном) аттракторе и m – мерное фазовое пространство разделено на ячейки размера l^m . Если P_{i_0, \dots, i_n} – совместная вероятность

Связь чисел I_1, I_2 с фрактальными и мультифрактальными размерностями специальных множеств и энтропией Колмогорова – Синая рассмотрим отдельно.

того, что $x(t) = 0$ находится в ячейке i_1 , $x(t) = \tau$ – в ячейке $i_2, \dots, x(t) + n - 1 \tau$ – в ячейке i_n , τ – интервал времени измерения состояния системы, то энтропия Шеннона определяется как

$$S_n = - \sum_{i_1, \dots, i_n} P_{i_1, \dots, i_n} \ln P_{i_1, \dots, i_n}. \quad (13)$$

Энтропия Колмогорова – Синая S (KS – энтропия) определяется как средняя скорость потери информации [2]:

$$\begin{aligned} S &= \lim_{\tau \rightarrow 0} \lim_{l \rightarrow 0} \lim_{N \rightarrow \infty} \frac{1}{N\tau} \sum_{n=1}^N S_{n+1} - S_n = \\ &= - \lim_{\tau \rightarrow 0} \lim_{l \rightarrow 0} \lim_{N \rightarrow \infty} \frac{1}{N\tau} \sum_{i_1, \dots, i_N} P_{i_1, \dots, i_N} \ln P_{i_1, \dots, i_N}. \end{aligned} \quad (14)$$

В случае дискретности шага по времени принимается $\tau = 1$ и предел $\tau \rightarrow 0$ опускается. По смыслу τ представляет собой характерное время и нелинейно зависит от l .

Естественно поставить вопрос: существует ли постоянное определенное значение KS-энтропии? Прежде всего необходимо выяснить

условия постоянства произведения $N\tau$ для масштабно – инвариантных пространственных и временных явлений.

По определению фрактальной размерности D некоторой фрактальной меры $N(l)$, зависящей только от одного масштаба измерения самоподобного множества имеем

$$N(l) = l^{-D}, \quad D = \lim_{l \rightarrow 0} \frac{\ln N(l)}{\ln 1/l}. \quad (15)$$

Мы можем выбрать в качестве $N(l)$ число переменных иерархической системы на этапе эволюции с минимальным характерным масштабом l . Самоаффинные множества пере-

менных различной природы (например, координаты и времени) описываются показателем Херста H (H называется также показателем аффинности):

$$\frac{R}{x^2(t)} = \tau^H, \quad R(\tau) = \max_{1 \leq t \leq \tau} x(t, \tau) - \min_{1 \leq t \leq \tau} x(t, \tau). \quad (16)$$

Для чисто стохастического броуновского движения $H = 1/2$. Для хаотических явлений $1/2 < H < 1$. Известны формулы

$$D = 1/H, \quad D = 2 - H, \quad (17)$$

соответственно для самоподобных и самоаффинных случаев, которые следуют из требования масштабной инвариантности обобщенного (“дробного”) броуновского движения [3].

Принимая безразмерную переменную l в виде $l = x^2 t^{-1/2} R$ из формул (15), (16), (17) получим

$$N\tau = l^{-D} l^{-1/H} = l^{-2D} = N^2, \tau = N. \tag{18}$$

Как ожидалось, самоподобие достигается при равенстве выбранных безразмерных мас-

штабов времени и количества переменных. В этом случае можно принять $\tau = 1$.

Для самоаффинного случая имеем

$$N\tau = l^{-D} l^{-1/2-D} = l^{-D_*}, D_* = D + 1/2, \tag{19}$$

где D_* может иметь смысл некоторого эффективного значения фрактальных размерностей самоаффинного множества. Отсюда сле-

дует возможность связи KS – энтропии с фрактальными и мультифрактальными характеристиками.

Из формулы Реньи для мультифрактальной размерности меры $N(q, l)$ имеем

$$D_q = \lim_{l \rightarrow 0} \frac{1}{q-1} \frac{\ln N(q, l)}{\ln l}, N(q, l) = \sum_{i=1}^N P_i^q l, \tag{20}$$

где q – порядок мультифрактального момента. Если дополнительно учесть переходы к преде-

лам для случая $i = i_1, \dots, i_N, N \rightarrow \infty, \tau \rightarrow 0$, то из формулы (20) при $q \rightarrow 1$ получим

$$D_{q \rightarrow 1} = D_1 = \lim_{l \rightarrow 0} \frac{S(l)}{\ln 1/l} = S_1, \tag{21}$$

где $S(l)$ – выражение (14), записанное без указания предела $l \rightarrow 0$. В многомерном случае $S(l)$ вычисляется через суммирование по индексам i_1, \dots, i_N .

Далее, чтобы сопоставить S_1 и S_{KS} мы выясним возможности равенства величин $N\tau$ и $\ln 1/l$. Для этой цели учтем, что самоаффин-

ность характеризуется множеством значений фрактальной размерности $D_i, i = 1, 2, \dots$. Тогда нормированное по D_{*i} значение $N\tau_{*i}$ определяется как $l^{-D_{*i}} \sum_i l^{-D_{*i}}$. В случае непрерывного спектра D_* имеем

$$N\tau_{*i} = l^{-D_{*i}} \int e^{-D_*} dD_* = \ln 1/l. \tag{22}$$

Эти рассуждения показывают возможность $S_{KS} = S_1$.

С другой стороны, из известной теории мультифрактальной спектральной функции $f(\alpha, q)$ следует

$$f \alpha q = q \alpha q + \tau q, \tau q = 1 - q D_q, \alpha q = -\frac{d\tau q}{dq},$$

$$\alpha q = 1 = \alpha_1, f \alpha q = 1 = f_1, D_1 = \alpha_1 = f_1 = S_1, \quad (23)$$

где α – показатель сингулярности ячейки множества (показатель Липшица – Гельдера), $f \alpha$ – фрактальная размерность множества ячеек с одинаковыми значениями α . По самому определению фрактальные характеристики D_1, α_1, f_1 не зависят от l , следовательно, S_1 тоже не зависит от l .

Приложения критериев самоподобия и самоаффинности

Интервал значений нормированной энтропии Шеннона $I_1 \leq S_n \leq I_2$ определяет самоорганизованный процесс включая его режимы самоаффинности и самоподобия. Этот факт облегчает физический анализ хаотических сигналов в нанoeлектронике, астрофизике, биофизике и т.д. Для одномерного сигнала $S_{n_{max}}$ равно энтропии равнобедренного треугольного импульса. В мно-

Таким образом, KS – энтропия, вычисленная по нормированному значению $N\tau_*$ равна самоподобному значению (неподвижной точке) информационной энтропии, т.е. числу I_2 . Критерий I_1 является неподвижной точкой функции плотности вероятности информации (“локальной энтропии”), поэтому является самоаффинным значением KS – энтропии.

гомерном случае можно использовать нормированную мультифрактальную спектральную функцию $f \alpha_1 = \alpha_1$ вместо S_n , т.к. $f_{max} \alpha = D_0$ и Хаусдорфова размерность D_0 вычисляется стандартными алгоритмами.

Числа I_1, I_2 определяют фрактальные меры самоаффинных и самоподобных явлений. Под мерой понимаем количественную характеристику любого аддитивного и измеримого множества. Фрактальная мера определяется как

$$M = M_0 l^{-D-d} = M_0 l^{-\gamma}, \quad (24)$$

где d – топологическая размерность носителя меры, M_0 – нефрактальная (регулярная) мера. Определим значения $\gamma = D - d$ через I_1, I_2 .

Примем обозначения d_{max} – наибольшее целочисленное значение D , $D_{max} = d_{max} + 1$, $I_* = I_1, I_2$. Возможны случаи

$$D = d_{max} + I_*, \gamma = D - d = d_{max} - d + I_*, d = 0,1,2,3; \quad (25)$$

$$D = D_{max} - I_* = d_{max} + 1 - I_*, \gamma = d_{max} - d + 1 - I_*, d = 0,1,2,3. \quad (26)$$

Формула (25) применима при “наружной” фрактализации, т.е. при расположении фрактальной меры вне регулярной меры. Этот случай можно рассматривать также как одномерный безусловный случай, соответствующий безусловным вероятностным процессам. При этом вместо D можно пользоваться информационной размерностью $D_1 = S_1 = I_2$. Согласно формуле (23) D_1 удовлетворяет условию само-

подобия. Формула (26) соответствует “внутренней” фрактализации. Появление слагаемого $1 - I$ можно обосновать, рассматривая размерность горизонтального сечения хаотического объекта [3].

Формулу (26) можно обосновать также из следующих рассуждений. Дробная часть фрактальной размерности равна минимальной информации, определенной в единицах $1/l$:

$$D - d_{max} = \log_{1/l} N_l \quad \log_{1/l} 1/l = -\log_{1/l} P_l = I. \tag{27}$$

С другой стороны, в формуле (2) безусловная энтропия S_x всегда больше, чем условная энтропия $S_{x|y}$ и нормируя все величины на S_x , имеем

$$I = 1 - S, \quad D - d_{max} = 1 - I_*, \tag{28}$$

где приняты масштабно-инвариантные значения $S = I_*$.

Общее число возможных значений γ для формулы (25) определяется как

$$N_\gamma = \sum_{i=1}^4 \sum_{j \leq i} \sum_{k=1}^2 d_{max,i} - d_j = 2 \sum_{i \geq j=1}^4 d_{max,i} - d_j = 2 \sum_{n=1}^4 n = 2 \cdot \frac{4+1}{2} = 20. \tag{29}$$

Такое же значение N_γ дает формула (26). Если использовать также значение числа Фибоначчи, т.е. принять $I_* = I_1, I_2, I_{20}$, то $N_\gamma = 30$. I_{20} имеет смысл переходного значения I_* от I_1 к I_2 .

Таким образом, мы имеем возможность использовать 20 точных значений фрактальной размерности D для каждого типа (внешней к внутренней фрактализации) задач. Если учесть, что определение фрактальной размерности D представляет отдельную задачу и известные методы ее определения из опыта обеспечивают точность, не превышающей порядка одного процента, то использование чисел I_1, I_2 значительно облегчает эту проблему.

Приведем примеры использования формул (25), (26). Пусть необходимо моделировать, или описать эксперименты по оптике квантовых ни-

тей на поверхности. Тогда $d_{max} = 2, d = 1$, по формуле (25) имеем $\gamma = 1 + 0,567$ для самоаффинного процесса, $\gamma = 1 + 0,806$ для самоподобного процесса. Если необходимо описать электрические явления в среде, то следует пользоваться формулой (26).

Выводы настоящей работы можно проверить, вычисляя энтропию Колмогорова – Синяя для различных фракталов. Геометрические фракталы являются удобными моделями иерархической динамической системы, так как каждое поколение фрактала можно сопоставить эволюционному уровню.

Мы выделим два варианта сравнения теории с численным экспериментом. Первый подход может быть основан на вычислении – энтропии только для одного звена фрактала по формуле (6).

$$S = (1 + I)e^{-I} = (1 + D \ln 1/l)e^{-D \ln^2 1/l}. \tag{30}$$

где, в отличие от формулы (27), информация определена через натуральный логарифм. Второй подход предполагает вычисление энтропии по формуле (14) для множества n поколений фрактала.

На рисунке представлена зависимость S, D согласно формуле (30). Названия фракталов общепринятые [4]. Согласно формуле (17) при

$D > 1,5$ имеем $H < 1/2$ (случаи отсутствия вероятностного поведения процесса) и необходимо пользоваться согласно (28) информацией вместо энтропии. Эти замены указаны стрелками. Расхождения $S > I_2$ связаны с тем, что этот график получен для дискретной модели одного звена, а критерии I_1, I_2 получены по теории непрерывных изменений энтропии.

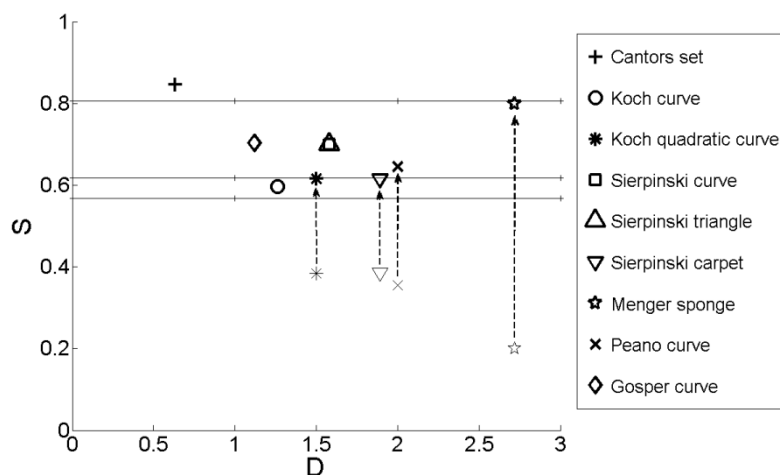


Рисунок – Нормированные энтропии одного звена модельных фракталов

Более близкие результаты к теории можно ожидать при использовании второго подхода, так как в этом случае мы рассматриваем множество фрактальных звеньев, у которых более четко проявляются статистические закономерности.

Заключение

Мы показали, что хаотические процессы и объекты могут быть количественно классифицированы на самоаффинные и самоподобные.

Соответствующие критерии I_1, I_2 являются значениями энтропии Колмогорова – Синяя, определяют характерные фрактальные меры. Существование этих критериев масштабной – инвариантности также доказывается соответствующей обработкой результатов экспериментальных исследований хаотических процессов различной природы (турбулентность, радиоизлучение Солнца, оптическое излучения переменных звезд и др.).

References

- 1 Klimontovich Yu.L. Information Concerning the States of Open Systems // Physica Scripta. – 1998. – Vol. 58. – P.549.
- 2 Slomczynski W., Kwapier J., Zyczkowski K. Entropy Computing Via Integration over Fractal Measures // Chaos. – 2000. – Vol. 10, №1. – P. 180-188.
- 3 Pietzonero L., Tosatti E. Fractals in Physics // Elsevier Science 1986.
- 4 Feder J. Fractals. – New York: Plenum press, 1988.