



Dynamik von Innovationen in stochastischen Modellen

Werner Ebeling *

R. Feistel**, I. Hartmann-Sonntag*, A. Neiman***

L. Schimansky-Geier*, A. Scharnhorst***

* Humboldt-Universität, Berlin

**Inst. Ostseeforschung, Warnemünde,

Ohio University, Ohio, KNAW, Amsterdam



1. Einleitung

- Stochast. Effekte spielen in sozioökon. Prozessen eine wichtige Rolle,
- zum Beispiel bei Innovationen und bei Übergängen zu anderen Technologien,
- Das einfache Bild: Das Neue/Bessere ersetzt das Alte/Schlechte ist zu einfach!!
- Wir benutzen Agenten, die sich stochastisch bewegen (Rolle des Zufalls!) und entwickeln zwei einfache (agent-based) mathem. Mod:

Vorwort



- Ein wesentlicher Schritt bei der Entwicklung von Wissenschaft und Technologie ist die Ersetzung von alten durch neue Elemente (Ideen, Erfindungen, Technologien), die meist der Befriedigung elementarer Bedürfnisse auf eine neue (bessere, günstigere) Weise dienen.
- Das neue vorteilhafte Element muss sich im Wettbewerb, in den es mit einer kleinen Zahl von Realisierungen eintritt, erst durchsetzen. In diesem stochastischen Prozess der Durchsetzung, kann auch eine neue und bessere Lösung nur mit einer gewissen Wahrscheinlichkeit überleben.
- Anhand einfacher mathematischer Modelle für Substitutions- und Übergangsprozesse wird demonstriert, wie sich das Neue durchsetzen kann.

1) Diskretes Urnen-Modell: Agenten, die zwischen Urnen springen

Schicksal neuer Agenten/Technologien im Verdrängungswettbewerb auf dem Markt



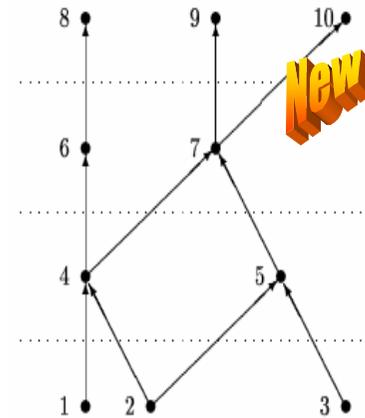
- stochastic effects are important if the advantage of the NEW is small
- selection is vague with a broad region of neutrality; in order to win the competition the NEW needs big advantage.
- technologies with nonlinear growth rates have only a chance to win in niches or with external support.

2) Modell Brownscher Agenten-Dynamik auf Landschaften: Übergänge zu neuen Technologien



- Technologies are modelled as active Brownian agents/particles with velocity-dependent forward thrust, external confinement and collective interactions.
- We simulate the dynamics of such transitions by Langevin equations and estimate parameters of the dynamics as the transition rates.

2. Stochastisches Urnenmodell



- Econ evo as agent dynamics in a **discrete** network
- A special role play transitions to new technologies (node 10).
- By changing the old, by new ideas, inventions= transition to a new node
- Fate of the NEW = stochastic on nodes
- Urn models !!!

Zur Begründung der agenten-basierten Methodik zitieren wir einen Experten:



Agent-Based Computational Economics, K. Judd and L. Tesfatsion, eds, ELSEVIER/North-Holland, forthcoming 2005.

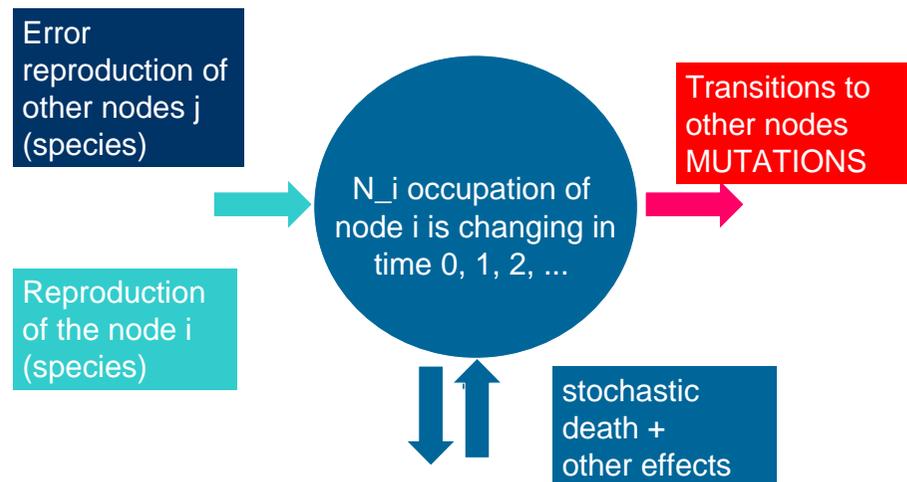
Out-of-Equilibrium Economics and Agent-Based Modeling

By W. Brian Arthur

Abstract

Standard neoclassical economics asks what agents' actions, strategies, or expectations are in equilibrium with (consistent with) the outcome or pattern these behaviors aggregatively create. Agent-based computational economics enables us to ask a wider question: how agents' actions, strategies, or expectations might react to—might endogenously change with—the patterns they create. In other words, it enables us to examine how the economy behaves out of equilibrium, when it is not at a steady state.

Stochastischer Wechsel der Besetzung von Knoten



Zur Geschichte stochast. Urnenmodelle



- Paul & Tatjana Ehrenfest 1907: Urn models (flees jump from dog to dog) . **First biophys. Appl.!!!**
- Bartholomay 1958/59, Bartlett 1960: Birth and death processes, survival probabilities
- Kimura/Eigen: Applications to problems of evolution **Applications to genetics population dynamics, etc.**

Wann lohnt stochast Analyse?



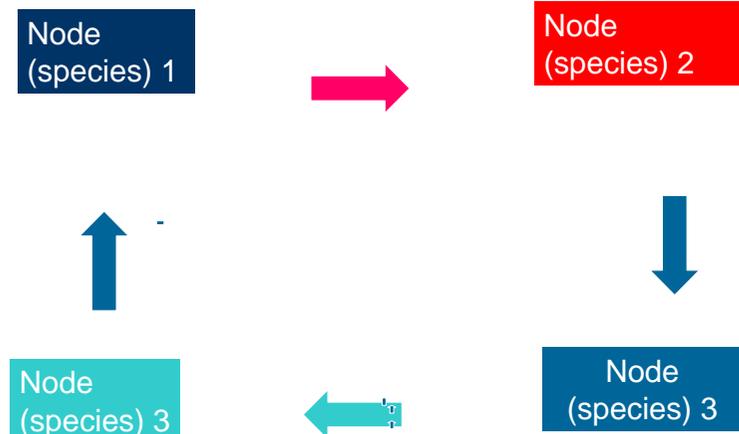
- In der Regel sind stochast Effekte sehr klein ($N \gg 1$). Es gibt aber Ausnahmen ($N=0,1$): Innovationen!
- Besonders interessant Innov mit Hyperzykluscharakter (vgl. Theorie der Hyperzyklen nach Eigen/Schuster)
- HC sind ringförmig vernetzte Technol mit hyperbol Wachstum (WINDOWS, GOOGLE, alles oder nichts!)

Transformation gegeb. det. DGI. auf stochast. Problem? Rezept ist klar für Polynome (transition probs ~ coeff.)

Special cases: Lotka-Volterra, Eigen-Schuster,..

$$\frac{d}{dt}x_i = \sum_j \left(A_{ij} x_j + B_{ij} N x_i x_j + \sum_k C_{ijk} N^2 x_i x_j x_k \right)$$

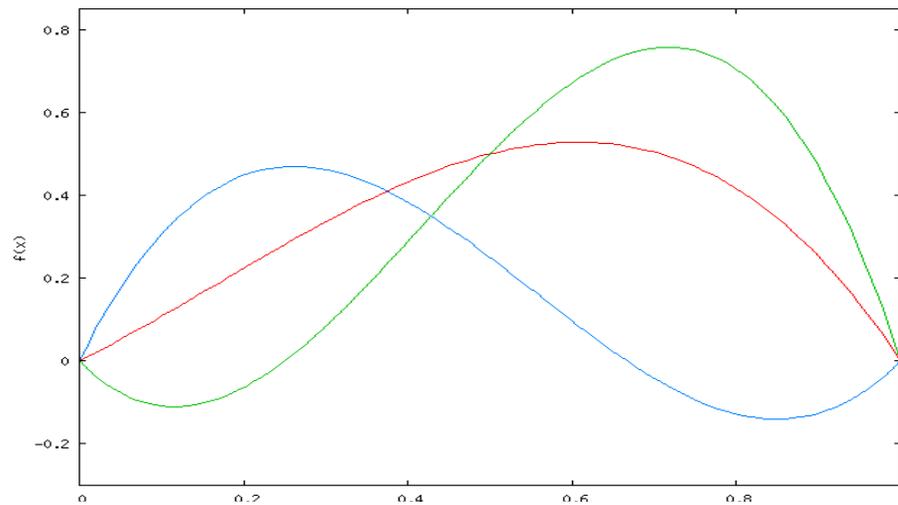
Hypercycl. vernetzte Technologien



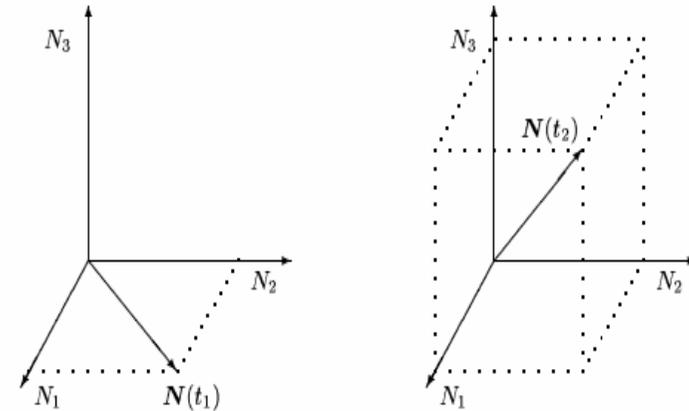
$$\frac{d}{dt} x = f(x) = a x + b x^2 - (a+b)x^3$$

u.a. mit Attraktor in der Mitte

oder mit Separatrix



Besetzungszahlraum



Stochast Modell (birth & death): def Knoten für Sorten und Besetzungszahlen



\circ_i non-occupied $N_i = 0$

\bullet_i occupied $N_i > 0$

Def Übergangswahrsch abhängig von
Koeffizienten in der det Dgl. Wahl der Koeff
erlaubt Modellierung vieler Prozesse

$$W(N_1, \dots, N_i + 1, \dots, N_j - 1, \dots, N_k | N_1, \dots, N_i, \dots, N_j, \dots, N_k)$$

$$= A_{ij} N_j + B_{ij} N_i N_j + \sum_k C_{ijk} N_i N_j N_k$$

Betrachte binären Verdrängungswettbewerb: 1=ALT, 2=NEU

1. Spontaneous generation (simple innovation)	$A_i^{(0)}$	
2. Self-reproduction	$A_i^{(1)} N_i$	
Error reproduction	$A_{ij}^{(1)} N_j$	
Catalytic self-reproduction (sponsored self-reproduction)	$\begin{cases} B_{ij}^{(1)} N_i N_j \\ C_{ijk}^{(1)} N_i N_j N_k \end{cases}$	
3. Spontaneous decay	$A_i^{(2)} N_i$	
Catalytic decay	$B_{ij}^{(2)} N_i N_j$	
4. Mutation (innovation)	$A_{ij}^{(3)} N_j$	
Mutation (innovation) with reproduction	$\begin{cases} B_{ij}^{(3)} N_i N_j \\ C_{ijk}^{(3)} N_i N_j N_k \end{cases}$	

- Consider a two-component system:
- The MASTER with dominant occupation:
- The NEW species with one, or a few, representatives which try to survive and (if possible) to win the competition.
- In general we will assume that e NEW is better with respect to reproductive rates



Formuliere eine Mastergl. als Balance elementarer Prozesse: Lösung i.a.schwer oder unmöglich - Hier Simplexbed $N = \text{const}$

$$\frac{\partial P(N; t)}{\partial t} = W(N|N') P(N') - W(N'|N) P(N)$$

$$N = \{N_0, N_1, N_2, \dots, N_s\}$$

ALT -->NEU = binärer Wettbewerb.
Wie scharf ist stochäst. Selektion?
Was ist stochäst. Neutralität ?

Node (species) 1



Node (species) 2

The message is:

Stochastic selection is very weak, nearly always neutral

Binäre Substitution N=const



$$\frac{\partial P(N_2; t)}{\partial t} = W_{N_2-1}^+(N_2 | N_2 - 1)P(N_2 - 1; t)$$

$$W_{N_2+1}^-(N_2 | N_2 + 1)P(N_2 + 1; t)$$

$$-W_{N_2}^+(N_2 + 1 | N_2)P(N_2; t)$$

$$-W_{N_2}^-(N_2 - 1 | N_2)P(N_2; t)$$

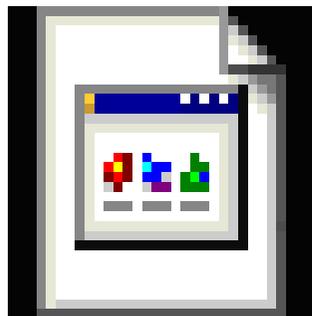
Only 1 independent variable N_2 (represent of the NEW)

Das allgemeine Überlebensproblem (survival between 2 absorbers)



- Untersuche den allgemeinsten 1 step Prozess ($W+$, $W-$) zwischen 2 Absorbieren
- $X=0 \leftarrow \dots o \dots \leftarrow \dots o \dots \leftarrow \dots o \dots \rightarrow \dots o \dots \rightarrow X=N$
- keine Absorber dazwischen, aber evtl. Extrema der Übergangswahrsch $W+$, $W-$ evtl. Attraktoren

Stochastische Simulation eines Prozesses mit anzieh Rändern (Pohl)



Komitee2.exe

Station Prob und Überlebensw



$$P(N_2; t \rightarrow \infty) = \sigma_1 \delta_{0, N_2} + \sigma_2 \delta_{N, N_2}$$

mit

$$\sigma_1 + \sigma_2 = 1$$

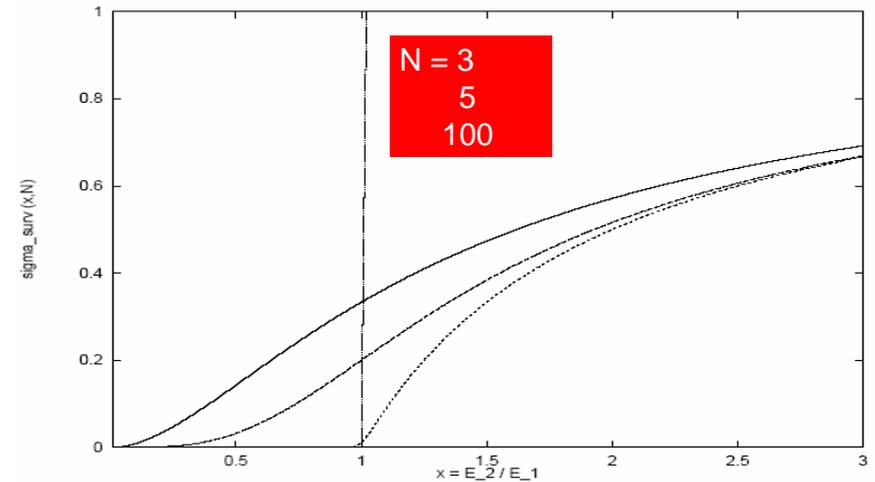


Mit welcher Wahrscheinlichkeit erreicht eine Trajektorie, die bei $X(0)=N_2(0)>0$ beginnt, den Absorber $X=N$?

$$\sigma = \frac{1 + \sum_{j=1}^{N_2(0)-1} \prod_{i=1}^j \frac{W_i^-}{W_i^+}}{1 + \sum_{j=1}^{N-1} \prod_{i=1}^j \frac{W_i^-}{W_i^+}}$$



Prob. of survival infinite generations in dep. on pop. size $N=3,5,100$ + determ. result

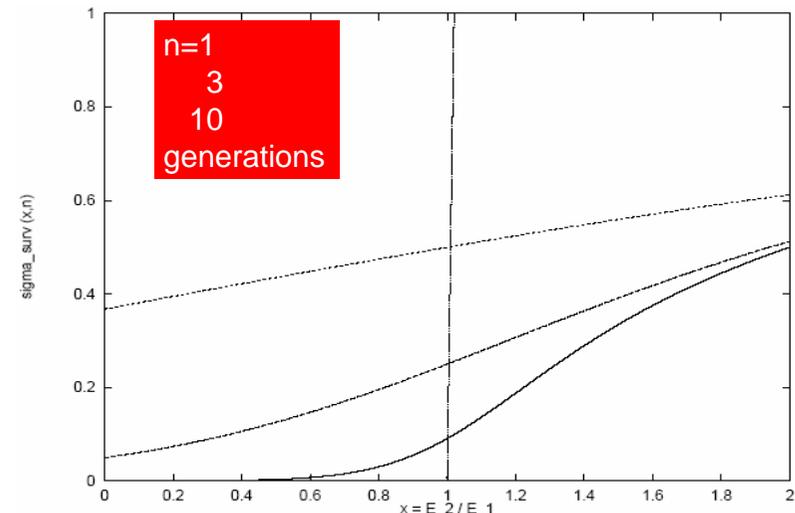


Lineare Raten, Überlebenswahrsch Bartholomay, Bartlett: N-gross

$$\sigma_2 = \begin{cases} 0 & \text{for } E_2 < E_1 \\ 1 - \left(\frac{E_1}{E_2}\right)^{N_2(0)} & \text{for } E_2 > E_1 \end{cases} \quad (24)$$

with $N_2(0) = N_2(t=0)$ the initial state of the system. Is $N_2(0)$ the number of users at time $t=0$ of the technology 2, then σ_2 is the probability, that for $t \rightarrow \infty$ $N_2 = N$ users change to technology 2. σ_1 is the probability that for $t \rightarrow \infty$ $N_2 = 0$ (i.e., $N_1 = N$) the system returns to species 1, this means the new species has not survived. In general, σ_i is the survival probability of

Prob of survival $n=10,3,1$ generations (from below) and determ. result as function of relative advantage (N-large)



Traditionelle Aussagen werden vage: Schlechter/Neutral/Besser



- Deleterious?
- neutral ??????
- Advantageous?
- Neutrality gets a new dynamic meaning (depending on N and n) !!!

Einfachstes Modell: lineare+quad W-terme

$$\frac{d}{dt} x_i = f(x) = a_i x_i + b_i x_i^2 - \varphi(t)x, \quad x_1 + x_2 = \text{const}$$

Separatrix

$$W^-(N_2) = \frac{a_1}{N} N_1 N_2 + \frac{b_1}{NV} N_1^2 N_2$$

$$W^+(N_2) = \frac{a_2}{N} N_1 N_2 + \frac{b_2}{NV} N_1 N_2^2$$

Nichtlin Raten = hyperzykl vernetzte Technologien (selbstbeschleun.)

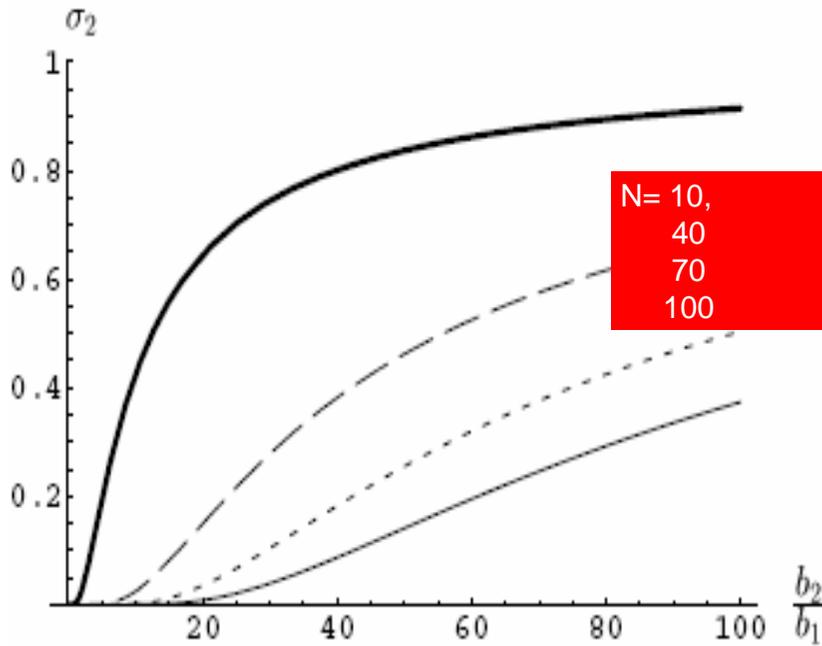
- DETERMINIST. BILD:
- Wachstum ist hyperbolisch !
(singulär für endliche Zeiten)
- Resultat hängt nicht nur vom (relativen) Vorteil sondern auch wesentlich von den Anfangsbedingungen ab!
- Das (unterkritische) Neue hat keine Chance ! (once-forever selection)
- B: moderne Infotec (Windows, Google,..)

Überlebenswahrsch. von 2



$$\sigma_{N_2(0), N} = \frac{1 + \sum_{j=1}^{N_2(0)-1} \prod_{i=1}^j \frac{E_1 + b_1 \frac{N-i}{V}}{E_2 + b_2 \frac{i}{V}}}{1 + \sum_{j=1}^{N-1} \prod_{i=1}^j \frac{E_1 + b_1 \frac{N-i}{V}}{E_2 + b_2 \frac{i}{V}}}$$

Einfach für $N_2(0)=1$



Der allgemeinste Fall von Ü-Wahrsch dritter Ordnung:



Das Neue, mit $N_2(0)$ startend, hat immer eine Chance (survival prob > 0)

$$\sigma_{N_2(o),N} = \frac{1 + \sum_{j=1}^{N_2(o)-1} \prod_{i=1}^j \frac{a_1 + b_1 \frac{N-i}{V} + c_1 \frac{i}{V}}{a_2 + b_2 \frac{i}{V} + c_2 \frac{N-i}{V}}}{1 + \sum_{j=1}^{N-1} \prod_{i=1}^j \frac{a_1 + b_1 \frac{N-i}{V} + c_1 \frac{i}{V}}{a_2 + b_2 \frac{i}{V} + c_2 \frac{N-i}{V}}}$$

Der allgemeinste Fall von Ü-Wahrsch bis dritte Ordnung:



Die Zustände $N_2=0$ und $N_2=N$ sind immer noch Absorber, aber in der Mitte können determ. Separatzen liegen

$$W^-(N_2) = \frac{a_1}{N} N_1 N_2 + \frac{b_1}{NV} N_2 N_1^2 + \frac{c_1}{NV} N_1 N_2^2$$

$$W^+(N_2) = \frac{a_2}{N} N_1 N_2 + \frac{b_2}{NV} N_1 N_2^2 + \frac{c_2}{NV} N_2 N_1^2$$

Hyperzykl vern Techn. verhalten sich stoch qualitativ anders als det!

- Deterministic picture: If a separatrix exists, the NEW has no chance at all.
- Stochastic picture: New hypertechns with better rates have a good chance.
- Exception: the NEW gets support, to cross the separatrix
- However this is true only for small niches

$$\overline{x_i = 0 \quad S_i \quad x_i = C}$$

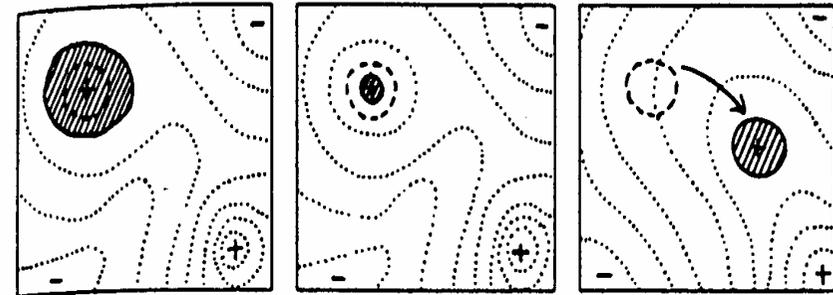
Fig. 1. Deterministic phase space with two fixpoint attractors and the separatrix point

A few references: discrete m.

- Feistel/Ebeling: Evolution of Complex Systems. Kluwer Dordrecht 1989
- Ebeling/Engel/Feistel: Physik der Evolutionsprozesse. Berlin 1990
- studia biophysica **84**, 87 (1981)
- J.Theor.Biol. **39**, 325 (1981)
- J. Evol. Economics **6**, 1 (1996)
- BioSystems **19**,91(1986), in press(2006)
- Physica A **287**, 599 (2000)
- arXiv:cond-mat/0406425 18 Jun 2004

Idee aus der Biologie: Wright Fitness landscape Evolution as Optimization Process

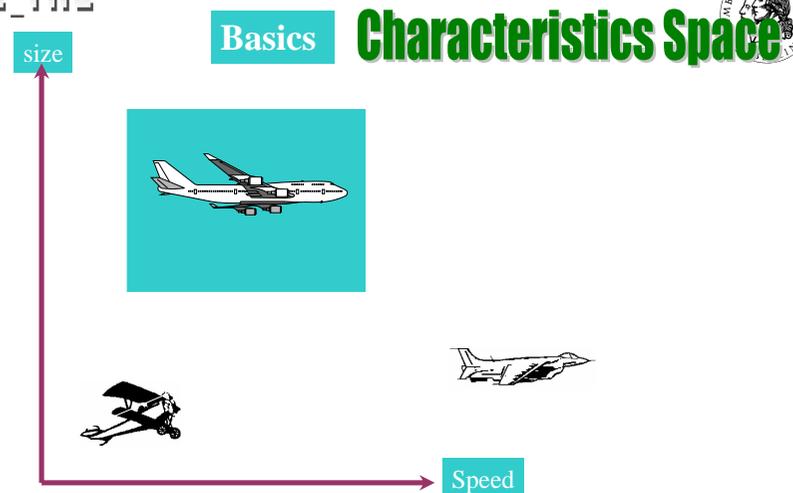
Adaptive Landscape/Fitness Landscape



A. Increased Mutation or reduced Selection
B. Increased Selection or reduced Mutation
C. Qualitative Change of Environment

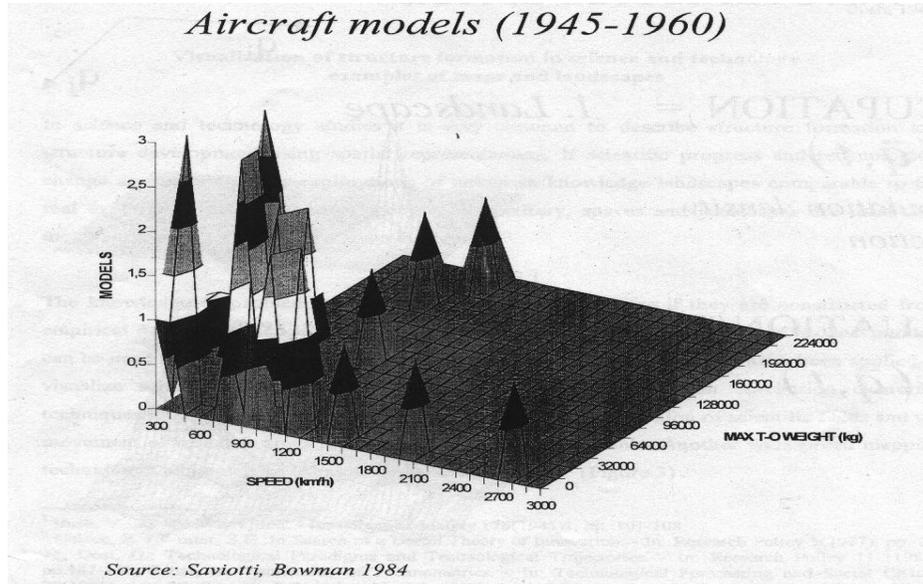
3. Modell Brownscher Agenten für Übergänge zu neuen Technologien

- Grundidee: Beschreibung einer Techn durch kontinuierl Parameter: Größe, Gewicht, Abmessungen, Leistung, techn Daten, ..., LANDSCHAFT
- Raum der kont. Charakteristiken (Metcalf, Saviotti seit 1984)
- Scharnhorst: G_O_E_THE (geometrisch orientierte Evolutionstheorie)



Technological Evolution:
Characteristics Space of Output Indicators

Darstellung nach Saviotti/Bowman, 1984



evolino



Dynamik evolutionärer Suchagenten in komplexen Landschaften



Kontakt:
Dr. Andrea Schamhorst
E-mail: andrea.schamhorst@nivi.knaw.nl

Entstanden in Rahmen des Projektes:
"Die Modellierung von Kompetenzen als Selbstorganisationsdispositionen menschlichen Handelns"

Gefördert durch das BMBF und den Europäischen Sozialfond, im Auftrag der ABWF

evolino – Dynamik evolutionärer Suchagenten in komplexen Landschaften – Anwendung auf die Modellierung der Rolle von Kompetenzen und Metakompetenz
[Deutsch >>](#)

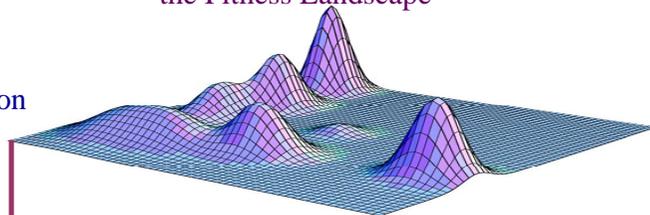
evolino – Dynamics of evolutionary search agents in complex landscapes – application to the modeling of competences
[English >>](#)

G_O_E_THE

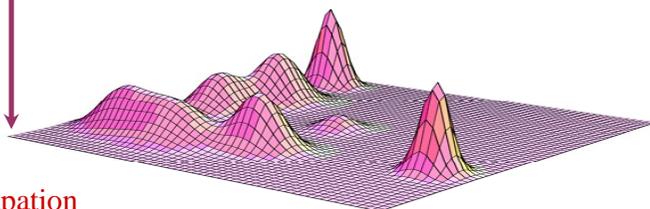
The Occupation Landscape Changes According to the Fitness Landscape



Valuation



Occupation



Die Eigensche Evo-Theorie entspr. im kont. Fall einer Diffgl für die Dichten bzw. einer überdämpften Langevin-Gl. für Koordinaten

$$\gamma_0 \frac{d}{dt} \mathbf{x} + \frac{1}{m} \frac{dU}{dr} = +\sqrt{2D} \cdot \xi(t); \quad v = \frac{d}{dt} \mathbf{x}$$

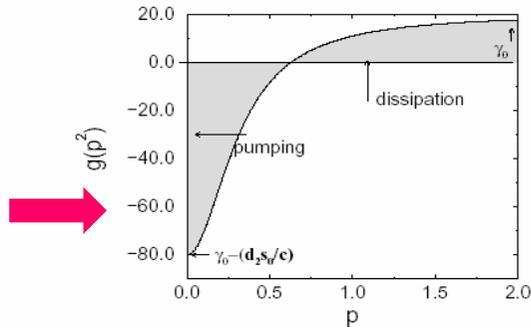
$$\frac{\partial}{\partial t} n = \nabla [D \nabla n + m \gamma_0 n \nabla U]$$

In der ABM - Theorie betrachten wir die Geschw. als unabhängige Variable, weiter berücksichtigen wir Trägheit und Vortrieb !!!

$$\frac{d}{dt} \mathbf{v} + \frac{1}{m} \frac{dU}{dr} = -\gamma(v^2) \mathbf{v} + \sqrt{2D} \cdot \xi(t)$$

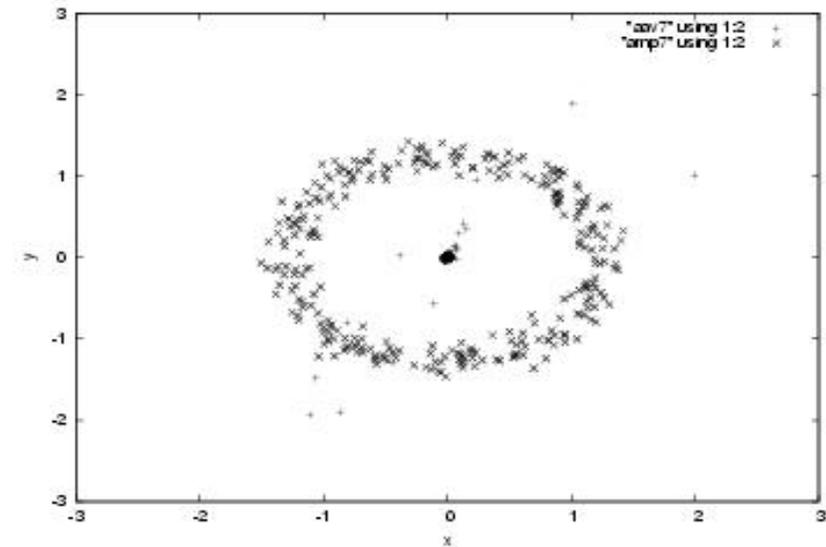


Depot model - SET



Active friction: Zero of the velocity $v_0^2 = \frac{d}{c} \mu$; $\mu = \frac{qd}{c\gamma_0} - 1$

Dynamik von Agenten, die linear zum Zentrum getrieben werden



Velocity-dependent friction: $\gamma(v^2)$



Thermal equilibrium: $\gamma(\mathbf{v}) = \gamma_0 = \text{const.}$
 Energy support (pumping) requires negative parts of $\gamma(\mathbf{v})$
 Rayleigh:

$$\mathbf{F} = (a - bv^2) \mathbf{v}$$

Gruher

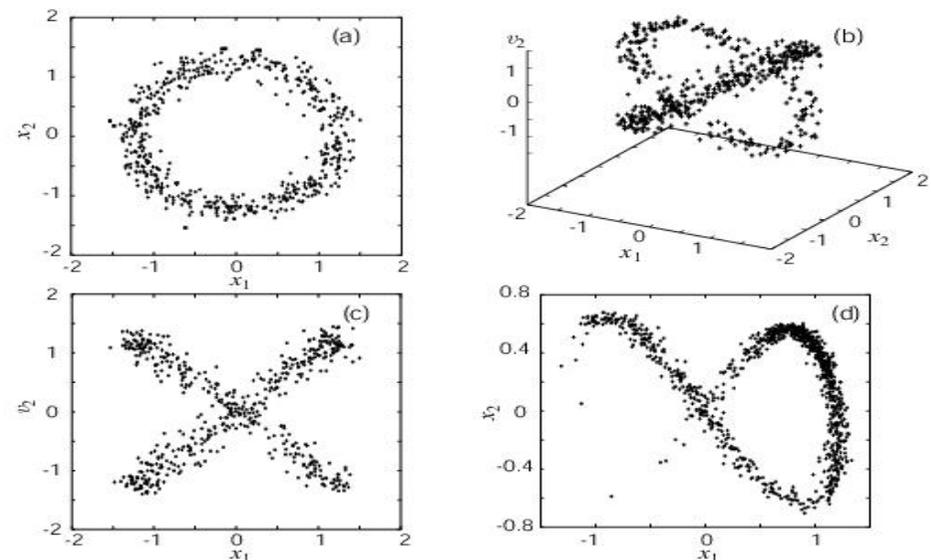
$$\mathbf{F} = G \left(\frac{v_0}{|\mathbf{v}|} - 1 \right) \mathbf{v}$$

Depot model (SET-model):

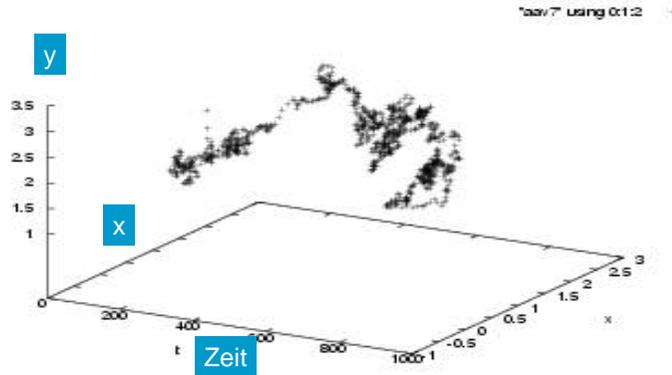
$$\gamma(v^2) = \left(\gamma_0 - \frac{dq}{c + dv^2} \right)$$

c, d, q = positive constants characterizing the energy flows from a depot to the particle

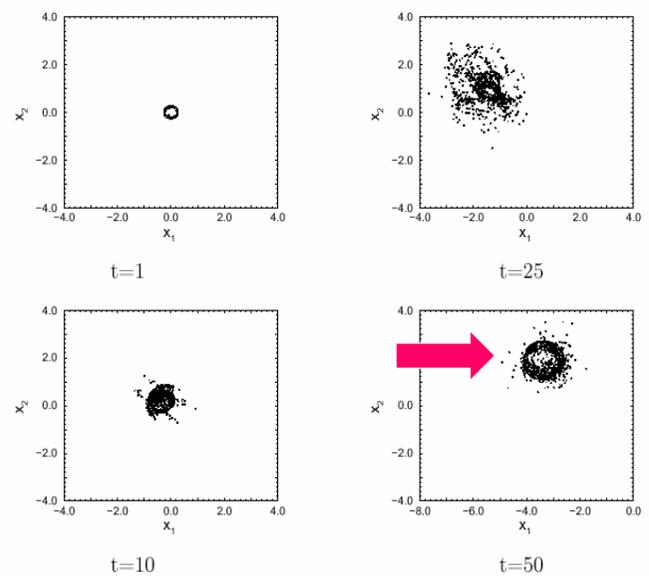
Rotationen (links/rechts): (limit cycles)



Schwärme von Agenten/Techn mit koll WW, lineare paarw Anziehung, die sich um das gemeins Zentrum (Schwerpunkt) bewegen

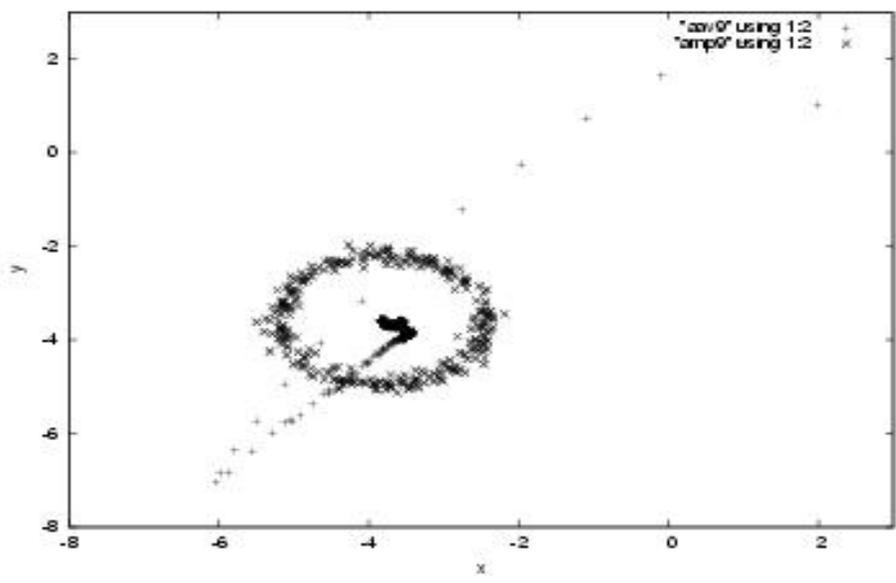


2000 Agenten mit paarweise linearer Anziehung

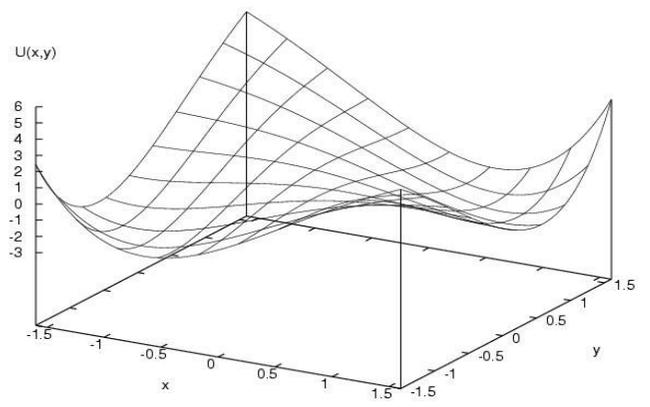


Swarm.gif

Rotationen um das Zentrum



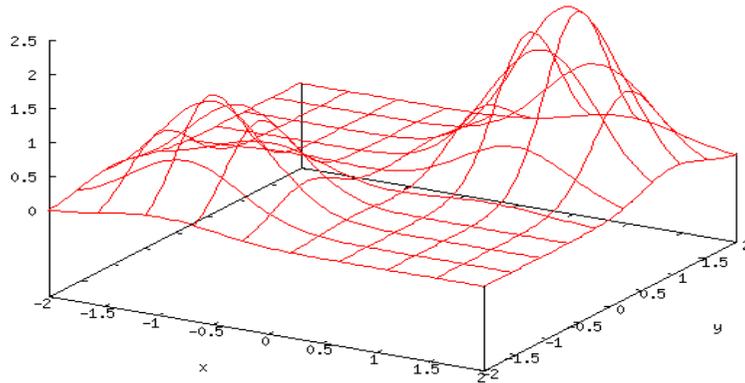
Übergänge zwischen 2 Anziehungszentren (from good to better)



Wertelandschaft (2 Maxima)

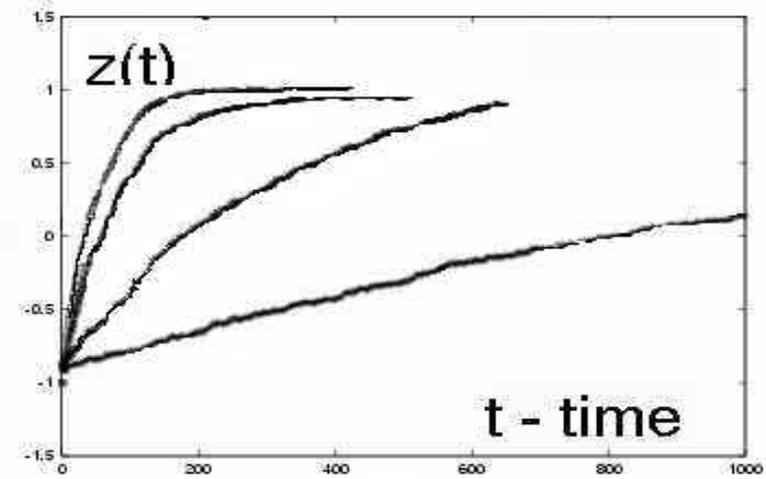


landscape with 2 hills:1.5;0.0;2.4---

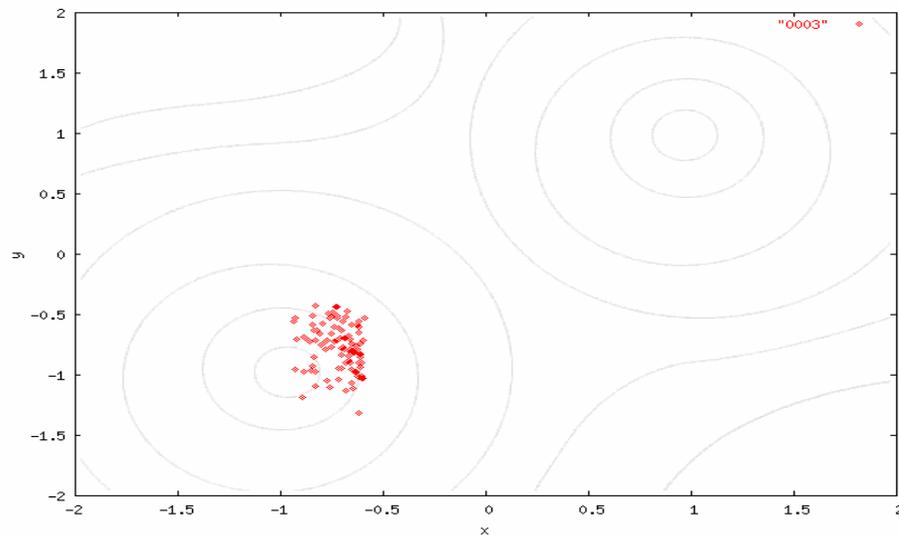


Trajektorien entlang der Diagonale (max to max) als Funktion des Antriebs

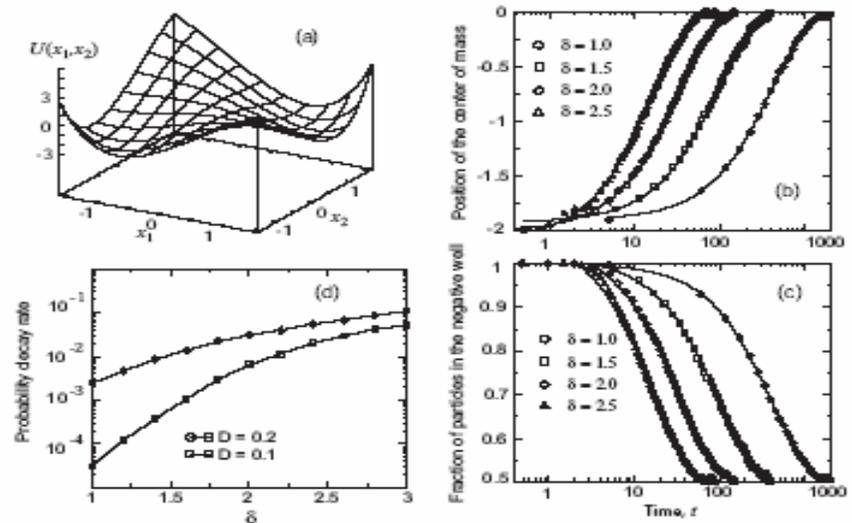
$\delta=2.5;2.0;1.7;1.5$



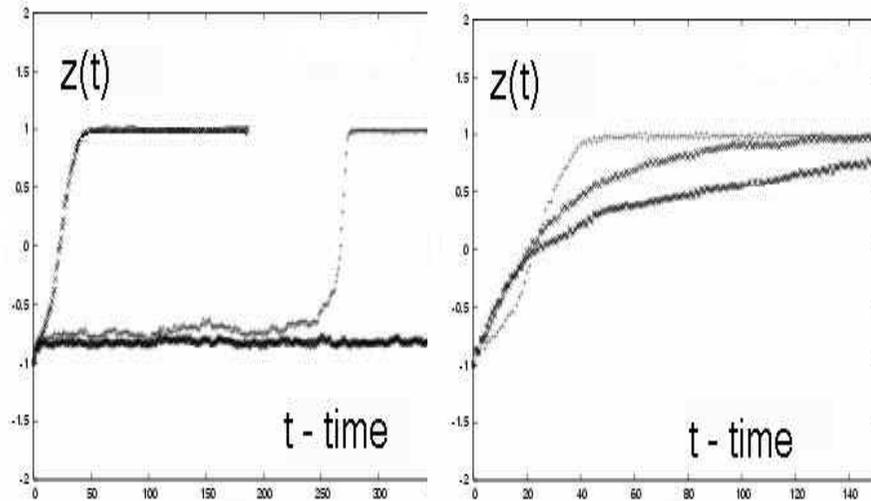
Simulation des Überganges von Agenten zum neuem Zentrum (Wertehügel)



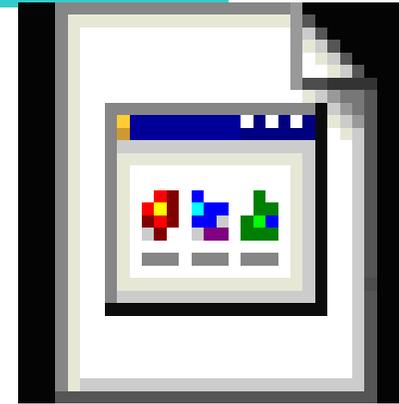
Übergangszeiten u. Wahrscheinl



Einfluß der kollektiven relativen Anziehung
 $l:a=0.5;1.0;1.2$ $r:a=0.5;0.0;-0.2$



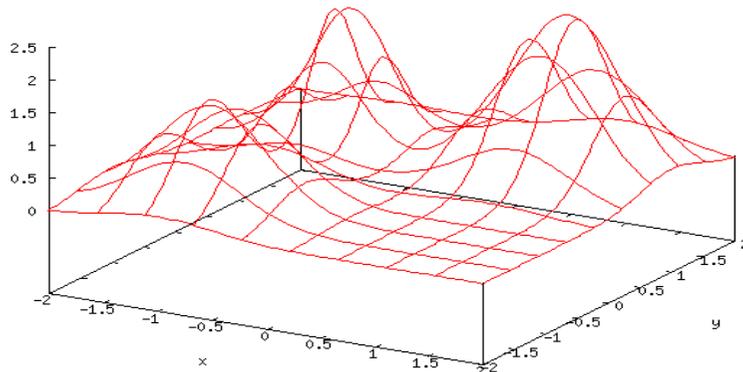
Übergänge zwischen 3 Werte Maxima



3max46.exe

Wertelandschaft mit 3 Maxima

landscape with 3 hills:1.5;2.0;2.4---



Landschaften mit vielen Extrema



- ➔ 1. Agenten auf Ratchets (Sägezahn-Potentiale) (Tilch et al.)
- ➔ 2. Landschaften mit zufällig verteilten Extrema (Asselmeyer, Dunkel et al.)

Referenzen zu Brown-Agenten



- Phys. Rev. Lett. **80**, 5044-5047 (1998)
- BioSystems **49**, 5044-5047 (1999)
- Eur. Phys. Journal B **15**, 105-113 (2000)
- Phys. Rev. E **64**, 021110 (2001)
- Schweitzer: Brownian agents..Berlin 2002
- Phys. Rev E **65**, 061106 (2002)
- Phys. Rev E **67**, 046403 (2003)
- Adv. Complex Systems 4, 71 (2001)
- Fluctuation & Noise Lett., (2004)

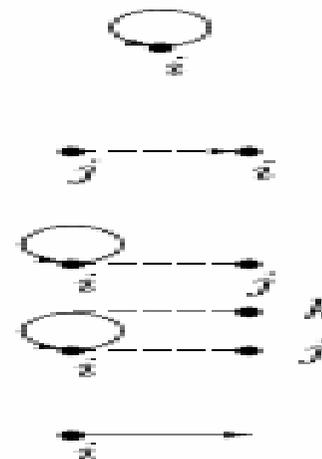


Zusammenfassung



- Stochastische Effekte sind manchmal für sozio-ökonomische Prozesse wichtig:
- Bei Innov mit linearen Raten erweist sich die stoch Selektion bei geringem Vorteil als vage, neutral. Gewinnen braucht große Vorteile !!!
- Hyperzykl. Systeme können nur in Nischen gewinnen, brauchen Förderung/Schutz!
- Komplexe Übergangs/Evolutions Prozesse mod als Dynamik Brown-Agenten auf Landschaften!
- Antrieb, kollekt. WW usw. --> inter. Effekte!!!

Use edges between the nodes fo characterizing processes like self-reproduction, mutations, catalytic reproductions, decay etc.



Loop =
selfreproduction



Solve if possible

- Analytical solutions. This is possible only for a few examples as:
- The Fisher-Eigen-Schuster problem
- Survival probabilities
- Simulations by means of a fast computer with sufficient memory
- Formulate efficient algorithms
- Extrapolate and compare with analytical results

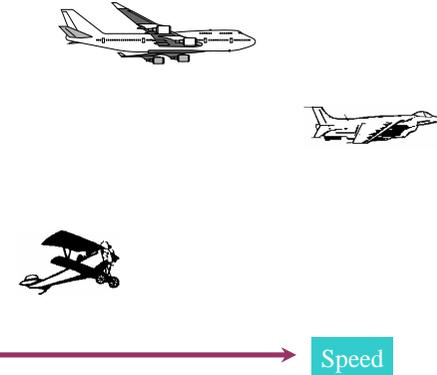
G_O_E_THE

Basics 1



Characteristics Space

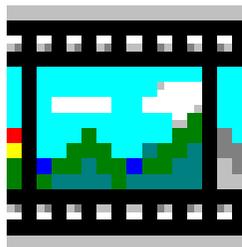
Engine size



Technological Evolution:

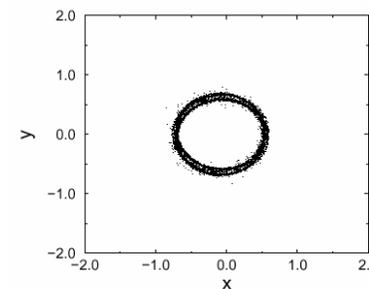
Characteristics Space of Output Indicators

Slideshow 3 hills



ASlides5a1.5.exe

10000 aktive Teilchen um linear anziehendes Zentrum: Einschwingprozess !



Swaest1.gif

Evolution von Netzwerken von Agenten(Illustration Erdmann)

