

Дискретная математика

1 Основные правила перечислительной комбинаторики

1.1. Начнем с очень краткого напоминания основных понятий теории множеств.

Определение 1.1. Множеством $X = \{x_1, x_2, \dots, x_n\}$ называется совокупность различных объектов $x_i, i = 1, \dots, n$, объединенных по некоторому признаку.

В качестве характерного примера можно рассмотреть, например, множество X всех студентов, находящихся в данной аудитории. Действительно, все студенты различимы, отличны друг от друга и объединены по признаку “собрались в данной аудитории”.

Определение 1.2. Мощностью $|X|$ множества X называется количество элементов в нем. Как правило, мы будем рассматривать конечные множества, в которых $|X| = n, n \in \mathbb{N}$, и называть их n -множествами.

1.1.1. Основные операции над множествами — это объединение $A \cup B$ (рис.1,a), пересечение $A \cap B$ (рис.1,b), разность $A \setminus B$ (рис.2,a) и симметрическая разность (рис.2,b) двух множеств A и B . В случае, если множество A является подмножеством некоторого более широкого множества X , удобно также рассматривать операцию дополнения $A' := X \setminus A$ множества A (рис.2,c).

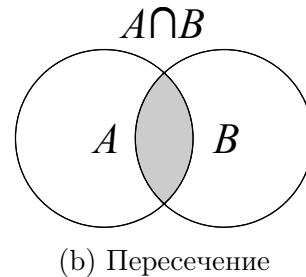
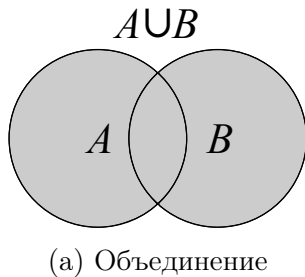


Рис. 1

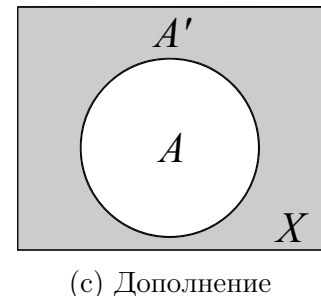
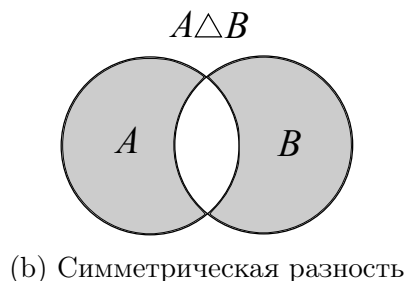
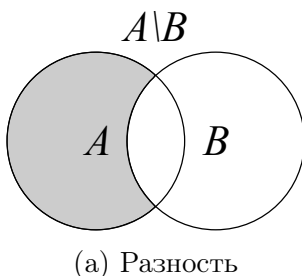


Рис. 2

Свойства операций над множествами удобно изучать графически, с использованием так называемых *диаграмм Эйлера-Венна* (смотри рисунки 1 и 2). Например, с их помощью достаточно просто проиллюстрировать справедливость законов де Моргана

$$A' \cap B' = (A \cup B)', \quad A' \cup B' = (A \cap B)' \quad (1)$$

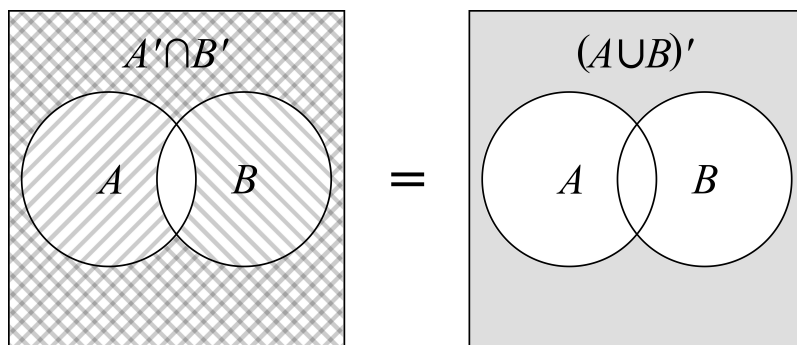


Рис. 3: Графическое доказательство закона де Моргана

(смотри рис.3).

1.1.2. В дальнейшем мы достаточно часто будем использовать понятие покрытия множества X семейством $\{X_1, X_2, \dots, X_k\}$ множеств, а также всевозможные частные случаи этого понятия.

Определение 1.3. Семейство множеств $\{X_1, X_2, \dots, X_k\}$ называется *покрытием* множества X , если их объединение дает нам все множество X :

$$X_1 \cup X_2 \cup \dots \cup X_k = X.$$

Важным частным случаем покрытия является понятие разбиения множества.

Определение 1.4. Говорят, что семейство множеств $\{X_1, X_2, \dots, X_k\}$ образует *разбиение* множества X , если

1. множества $X_i \neq \emptyset, i = 1, \dots, n$;
2. $X_i \cap X_j = \emptyset \forall i \neq j$;
3. $X_1 \cup X_2 \cup \dots \cup X_k = X$.

Элементы X_i этого семейства называются *блоками* разбиения.

В качестве характерного примера можно рассмотреть разбиение студентов данного курса на группы. Студенческие группы являются при этом блоками данного разбиения.

Если по каким-то причинам оказывается важным порядок следования блоков, то говорят об *упорядоченном разбиении* $(X_1, X_2, \dots, X_k)$ множества X . Например, если мы выводим группы на сцену для вручения им дипломов, то важен порядок, в котором они туда выходят. Следовательно, в данном случае мы получаем упорядоченное разбиение студентов данного курса.

Наконец, еще одним частным случаем покрытия X семейством множеств $\{X_1, X_2, \dots, X_k\}$ является понятие *разделения* множества X . Разделение есть аналог упорядоченного разбиения, в котором допускаются пустые блоки. Точное определение таково:

Определение 1.5. Разделением множества X называется упорядоченная последовательность $(X_1, X_2, \dots, X_k)$ возможно пустых, попарно непересекающихся множеств, объединение которых дает все множество X .

1.1.3. Еще одной часто используемой в комбинаторике операцией над множествами является операция декартова произведения множеств.

Определение 1.6. Декартовым произведением множеств A и B называется множество

$$A \times B := \{(a, b) \mid a \in A, b \in B\}$$

всех упорядоченных пар (a, b) , таких, что $a \in A, b \in B$.

В качестве простейшего примера декартова произведения множеств обычно приводят шахматную доску. Любая клетка шахматной доски имеет координаты “буква-цифра”, например, $e5$ или $h4$. Иными словами, координаты клеток шахматной доски являются элементами декартова произведения множеств $A = \{a, b, \dots, h\}$ и $B = \{1, 2, \dots, 8\}$.

В частном случае множества A и B могут совпадать. В этом случае декартово произведение $A \times A$ обозначается через $A^{(2)}$.

Определение 1.7. Декартовым произведением k множеств $X_1, X_2, \dots, X_k$ называется множество

$$X_1 \times X_2 \times \dots \times X_k := \{(x_1, x_2, \dots, x_k) \mid x_i \in X_i, \forall i = 1, \dots, k\}$$

всевозможных упорядоченных k -элементных последовательностей вида $(x_1, x_2, \dots, x_k)$.

В частном случае $X_1 = X_2 = \dots = X_k = X$ имеем декартову степень $X \times X \times \dots \times X =: X^{(k)}$.

1.1.4. Любой элемент $X^{(k)}$ есть упорядоченный набор из k элементов множества X , в котором некоторые элементы могут повторяться. Если же в таком k -множестве порядок элементов не важен, говорят о k -мультимножестве над множеством X . Формальное определение k -мультимножества таково.

Определение 1.8. k -мультимножеством над n -элементным множеством X называется пара (X, φ) , где $\varphi: X \rightarrow \mathbb{Z}_+$ есть функция, сопоставляющая любому элементу $x \in X$ количество $\varphi(x)$ его вхождений в k -мультимножество.

Любую функцию φ такого рода можно определить с помощью множества Ξ упорядоченных пар

$$\Xi := \{(x, \varphi(x)) \mid x \in X\}.$$

Поэтому, например, 3-мультимножество над множеством $X = \{x, y\}$, состоящее из двух элементов x и одного элемента y , можно формально записывать в виде $(X, \{(x, 2), (y, 1)\})$. Однако чаще вместо такой формальной записи используют более наглядную форму записи вида $\{x, x, y\}$.

Самый простой и понятный пример мультимножества — это монеты в кошельке. В этом примере в качестве множества X выступает множество из девяти монет разного достоинства:

$$X = \{1 \text{ копейка}, 5 \text{ копеек}, 10 \text{ копеек}, 50 \text{ копеек}, 1 \text{ рубль}, 2 \text{ рубля}, 5 \text{ рублей}, 10 \text{ рублей}\}.$$

Любой набор из этих монет в количестве k штук образует k -мультимножество над множеством X .

1.1.5. Теория множеств как раздел математики создавалась значительно позже комбинаторики. Поэтому некоторые наиболее важные понятия теории множеств исторически получили в комбинаторике свои, специфические названия. Именно,

1. k -сочетанием без повторений называется любое k -элементное подмножество n -элементного множества;
2. k -сочетанием с повторениями называется любое k -мультимножество над n -множеством;
3. k -перестановкой без повторений называется упорядоченное k -подмножество n -элементного множества;
4. k -перестановкой с повторениями называется любой элемент декартовой степени $X^{(k)}$.

1.2. Теперь перейдем к двум самым простым, но в то же время достаточно важным правилам перечислительной комбинаторики — правилу суммы и правилу произведения.

1.2.1. Начнем с простейшего примера: пусть на одном блюде лежат три яблока, а на втором — две груши; сколькими способами можно выбрать один фрукт? Ответ очевиден: пятью способами.

Обобщающее этот пример простейшее *правило суммы* можно сформулировать так: если некоторый объект из множества A можно выбрать k способами, и, вне зависимости от выбора этого объекта, можно n способами выбрать некоторый элемент множества B , то выбор объекта из множества A *или* из множества B можно осуществить $k + n$ способами.

Очевидна переформулировка этого правила на языке теории множеств: пусть пересечение двух множеств A и B пусто; тогда

$$|A \cup B| = |A| + |B|.$$

В частности, если $A \subset X$ и A' — дополнение множества A , то

$$|A| + |A'| = |X|. \quad (2)$$

В более общем случае, рассматривая произвольное разбиение множества X на блоки, имеем равенство вида

$$|X| = |X_1| + |X_2| + \dots + |X_k|,$$

которое также называется *правилом суммы* в комбинаторике.

1.2.2. Под *правилом произведения* в комбинаторике понимается равенство

$$|X_1 \times X_2 \times \dots \times X_k| = |X_1| \cdot |X_2| \cdot \dots \cdot |X_k|.$$

Приведем простейший пример на применение этого правила в комбинаторике. Пусть в аудитории находятся 32 студента одной группы, 24 студента другой группы и 17 студентов третьей группы. В этом случае тройку, состоящую из представителей каждой группы, можно выбрать $32 \cdot 24 \cdot 17$ способами.

1.3. Наряду с *правилом суммы*, в элементарной комбинаторике также достаточно часто используется и несложное его обобщение — так называемый *принцип включения-исключения*. Если *правило суммы* связано с разбиением множества X , то *принцип включения-исключения* связан с некоторым произвольным покрытием этого n -множества семейством $\{X_1, X_2, \dots, X_k\}$. Сформулируем его для самого простого случая двух множеств.

1.3.1. Рассмотрим два конечных множества A и B , пересечение которых может быть и непусто. Тогда количество элементов в объединении этих множеств, очевидно, равно

$$|A \cup B| = |A| + |B| - |A \cap B|. \quad (3)$$

Действительно, когда мы считаем количество $|A|$ элементов в множестве A и складываем его с количеством $|B|$ элементов в множестве B , мы любой элемент, принадлежащий как множеству A , так и множеству B , считаем дважды. Чтобы этот избыток убрать, нам нужно один раз вычесть количество элементов, содержащихся в пересечении этих двух множеств.

Равенство (3) можно называть обобщенным правилом суммы — оно обобщает правило суммы на случай, когда пересечение двух множеств не пусто.

1.3.2. Предположим теперь, что A и B являются подмножествами некоторого более широкого множества X . В этом случае у множества $A \subset X$ и множества $B \subset X$ имеются дополнения к ним — множества A' и B' , причем $A \cup A' = B \cup B' = X$.

Рассмотрим теперь пересечение $A' \cap B'$ дополнений множеств A и B . Согласно одной из теорем де Моргана (1), $A' \cap B' = (A \cup B)'$. Следовательно, количество элементов в этом пересечении с учетом равенства (2) и обобщенного правила суммы (3) можно сосчитать так:

$$|A' \cap B'| = |(A \cup B)'| = |X| - |A \cup B| = |X| - |A| - |B| + |A \cap B|.$$

Равенство

$$|A' \cap B'| = |X| - |A| - |B| + |A \cap B|, \quad (4)$$

и называется в комбинаторике принципом включения-исключения.

1.3.3. Приведем простейший пример его использования. Пусть в аудитории находятся 30 человек, 20 человек из которых знают английский, 12 — французский, а 6 человек знают оба языка. Сколько человек не знает ни один из этих иностранных языков? Ответ, согласно принципу включения-исключения (4), следующий:

$$N = 30 - 20 - 12 + 6 = 4.$$

1.3.4. Несложно обобщить равенства (3) и (4) на случай большего количества множеств. Например, для трех множеств A , B , C соответствующие формулы выглядят так:

а) обобщенное правило суммы:

$$|A \cup B \cup C| = |A| + |B| + |C| - |A \cap B| - |A \cap C| - |B \cap C| + |A \cap B \cap C|; \quad (5)$$

б) принцип включения-исключения:

$$|A' \cap B' \cap C'| = |X| - |A| - |B| - |C| + |A \cap B| + |A \cap C| + |B \cap C| - |A \cap B \cap C|. \quad (6)$$

Действительно, рассмотрим, к примеру, левую часть равенства (5). Она подсчитывает количество элементов, принадлежащих объединению трех множеств (смотри рис.4). Если элемент x_1 , принадлежащий этому объединению, содержится в множестве A , но не содержится в множествах B и C , то он один раз подсчитывается в правой части равенства (5) (слагаемое $|A|$, отвечающее зеленой подобласти на рис.4). Если элемент x_2 принадлежит множествам A и B , но не принадлежит C (красная подобласть на рис.4), то в правой части (5) этот элемент входит в слагаемые $|A|$, $|B|$ и $-|A \cap B|$, то есть также подсчитывается ровно один раз. Наконец, если x_3 принадлежит пересечению всех трех множеств (зеленая подобласть на рис.4), то за этот элемент отвечают все слагаемые в правой части (5). Так как четыре из них входят со знаком плюс, а три — со знаком минус, то этот элемент также считается в правой части (5) лишь однажды.

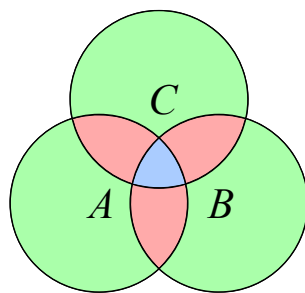


Рис. 4: Диаграмма Эйлера-Венна для трёх множеств

2 Подсчет k -сочетаний из n элементов. Биномиальные коэффициенты.

2.1. Основная задача данного параграфа состоит в подсчете количества всех k -сочетаний из n элементов. Начнем мы с подсчета количества k -сочетаний из n элементов без повторений.

2.1.1. Число k -сочетаний без повторений известно в литературе под названием биномиальных коэффициентов. Ранее в советской литературе такие числа обозначались через C_n^k . В настоящее время для этих коэффициентов используется обозначение $\binom{n}{k}$ (читается “из n по k ”).

2.1.2. Обычно на вопрос, чему равны биномиальные коэффициенты, вспоминают формулу

$$\binom{n}{k} = \frac{n!}{k!(n-k)!}.$$

Эта формула не очень удачна с двух точек зрения — с вычислительной и с идейной. С вычислительной точки зрения ее затруднительно использовать для достаточно больших значений n и k . Например, при $n = 38$ и $k = 19$ числитель и знаменатель могут просто не уместиться в диапазон изменения целых чисел для того или иного языка программирования. С идейной же точки зрения эта формула неудобна потому, что она не позволяет обобщить понятие биномиальных коэффициентов на случай целых, вещественных или комплексных значений n . В следующем параграфе мы получим более удобное выражение для этих коэффициентов, допускающее такое обобщение. Здесь же мы с помощью правила суммы выведем рекуррентное соотношение для биномиальных коэффициентов, позволяющее эти биномиальные коэффициенты эффективно вычислять для достаточно больших значений n и k .

2.1.3. Для получения рекуррентного соотношения введем множество Σ_k всех k -элементных подмножеств n -элементного множества X . Например, для $X = \{x_1, x_2, x_3\}$ множество $\Sigma_2 = \{\{x_1, x_2\}, \{x_1, x_3\}, \{x_2, x_3\}\}$. Заметим, что биномиальный коэффициент $\binom{n}{k}$ как раз и описывает мощность такого множества. Разобьем теперь множество Σ_k на два блока — блок $\Sigma_k^{(1)}$, k -элементные подмножества которого содержат элемент x_1 , и блок $\Sigma_k^{(2)}$, подмножества которого этот элемент не содержат. Понятно, что это — непустые, непересекающиеся подмножества, объединение которых дает нам все множество Σ_k . Поэтому по правилу суммы мы получаем равенство вида

$$\binom{n}{k} = |\Sigma_k| = |\Sigma_k^{(1)}| + |\Sigma_k^{(2)}|.$$

Осталось выразить через биномиальные коэффициенты количество элементов в каждом из блоков $\Sigma_k^{(1)}$, $\Sigma_k^{(2)}$. А это делается довольно легко.

2.1.4. Действительно, во всех подмножествах первого блока элемент x_1 уже выбран, и нам из оставшегося $(n - 1)$ -элементного множества $X \setminus x_1$ остается выбрать $(k - 1)$ -элементные подмножества. Сделать это можно $\binom{n-1}{k-1}$ способами. Во втором блоке содержатся k -элементные подмножества множества $X \setminus x_1$, состоящего из $(n - 1)$ -го элемента. Их количество, очевидно, равно $\binom{n-1}{k}$. Таким образом окончательно имеем следующее рекуррентное соотношение:

$$\binom{n}{k} = \binom{n-1}{k-1} + \binom{n-1}{k}, \quad k \geq 1, \quad n \geq 1. \quad (7)$$

2.1.5. Соотношение (7) следует дополнить начальными и граничными условиями. Так как k -элементных подмножеств n -элементного множества в случае $k > n$ не существует, то

$$\binom{n}{k} = 0 \quad \text{при} \quad k > n.$$

Далее, пустое подмножество можно выбрать всегда и только одним способом; поэтому

$$\binom{n}{0} = 1 \quad \forall n \geq 0.$$

Используя эти условия, можно шаг за шагом вычислить коэффициенты $\binom{n}{k}$. Часто их записывают в виде так называемого треугольника Паскаля:

$$\begin{array}{ccccccc} & & & & 1 & & & \\ & & & & 1 & & 1 & \\ & & & 1 & & 2 & & 1 \\ & & 1 & & 3 & & 3 & & 1 \\ & 1 & & 4 & & 6 & & 4 & & 1 \\ & & & & & \dots & & & & \end{array}$$

2.1.6. Как видно, треугольник Паскаля симметричен, т.е. $\binom{n}{k} = \binom{n}{n-k}$. Комбинаторное доказательство этого факта очевидно. Действительно, выбирая любое k -элементное множество, мы тем самым однозначно выбираем и дополнение к нему, т.е. $(n - k)$ -элементное множество. Следовательно, количество k -элементных и $(n - k)$ -элементных подмножеств совпадает.

2.2. Наряду с треугольником Паскаля биномиальные коэффициенты допускают и еще одно очень удобное графическое представление — представление на координатной плоскости (n, k)

2.2.1. Данное представление связано со следующей довольно интересной комбинаторной задачей. Рассмотрим плоскость (n, k) и нарисуем на этой плоскости пути, исходящие из начала координат, приходящие в точку с координатами (n, k) , $n \geq 0$, $k = 0, \dots, n$, и состоящие из диагональных и вертикальных отрезков (рис.5). В самих точках (n, k) отметим количество таких путей, приходящих в эту точку из начала координат. Заметим теперь, что попасть в точку с координатами (n, k) мы можем, пройдя только лишь через точку с координатами $(n - 1, k)$ или через точку с координатами $(n - 1, k - 1)$. С комбинаторной точки зрения это означает, что количество путей $\binom{n}{k}$, приходящих в точку с координатами (n, k) , равняется количеству $\binom{n-1}{k}$ путей, приходящих в точку с координатами $(n - 1, k)$, плюс количество путей $\binom{n-1}{k-1}$, приходящих в точку с координатами $(n - 1, k - 1)$. Но равенство

$$\binom{n}{k} = \binom{n-1}{k} + \binom{n-1}{k-1}$$

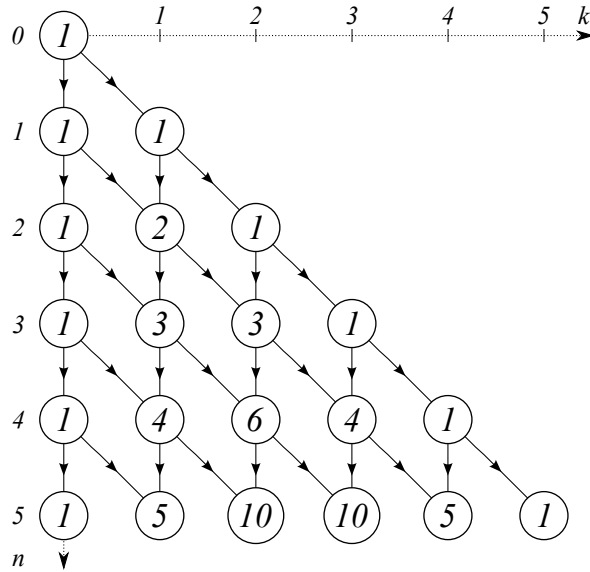


Рис. 5: Графическое представление чисел $\binom{n}{k}$ на координатной плоскости (n, k)

есть основное тождество для биномиальных коэффициентов (7). А это означает, что мы получили новую комбинаторную интерпретацию таких коэффициентов. Именно, числа $\binom{n}{k}$ описывают количество путей, состоящих из диагональных $(1, 1)$ и вертикальных $(1, 0)$ отрезков, выходящих из начала координат — точки $(0, 0)$, и оканчивающихся в точке с координатами (n, k) .

2.2.2. Графическое представление чисел $\binom{n}{k}$ на плоскости (n, k) очень удобно для получения разного рода тождеств с биномиальными коэффициентами. В качестве первого примера зафиксируем какое-то конкретное значение параметра k и просуммируем биномиальные коэффициенты $\binom{m}{k}$ по m от k до некоторого фиксированного значения n . Например, выберем $k = 1$, $n = 4$. Складывая числа 1, 2, 3, 4, мы получим число 10, то есть биномиальный коэффициент, стоящий правее и ниже рассмотренной цепочки биномиальных коэффициентов. Есть подозрение, что данный факт, а именно, равенство вида

$$\binom{k}{k} + \binom{k+1}{k} + \dots + \binom{n}{k} = \binom{n+1}{k+1} \quad (8)$$

выполняется для любых значений параметров n и k .

2.2.3. Для формального доказательства тождества

$$\sum_{m=0}^n \binom{m}{k} = \underbrace{\binom{0}{k} + \binom{1}{k} + \dots + \binom{k-1}{k}}_{=0} + \binom{k}{k} + \binom{k+1}{k} + \dots + \binom{n}{k} = \sum_{m=k}^n \binom{m}{k} = \binom{n+1}{k+1},$$

называемого формулой суммирования биномиальных коэффициентов по верхнему индексу, применим рекуррентное соотношение (7) к коэффициенту $\binom{m+1}{k+1}$:

$$\binom{m+1}{k+1} = \binom{m}{k} + \binom{m}{k+1} \quad \Rightarrow \quad \binom{m}{k} = \binom{m+1}{k+1} - \binom{m}{k+1}.$$

Просуммируем теперь полученное равенство по m от k до n :

$$\begin{aligned}\sum_{m=k}^n \binom{m}{k} &= \binom{n+1}{k+1} + \sum_{m=k}^{n-1} \binom{m+1}{k+1} - \sum_{m=k}^n \binom{m}{k+1} = \\ &= \binom{n+1}{k+1} + \sum_{m=k}^{n-1} \binom{m+1}{k+1} - \sum_{m=k+1}^n \binom{m}{k+1} = \\ &= \binom{n+1}{k+1} + \sum_{m'=k+1}^n \binom{m'}{k+1} - \sum_{m=k+1}^n \binom{m}{k+1} = \binom{n+1}{k+1}.\end{aligned}$$

2.2.4. Комбинаторное доказательство тождества (8) основано на следующем общем подходе: мы разбиваем множество Σ_{k+1} всех $(k+1)$ -элементных подмножеств $(n+1)$ -элементного множества X на блоки, подсчитываем количество элементов в каждом блоке, а затем пользуемся правилом суммы для подсчета числа $|\Sigma_{k+1}| = \binom{n+1}{k+1}$.

Для реализации этого подхода возьмем $(n+1)$ -элементное множество

$$X = \{x_1, x_2, \dots, x_{k-1}, x_k, x_{k+1}, \dots, x_{n-1}, x_n, x_{n+1}\}$$

и будем разбивать множество всех $(k+1)$ -элементных подмножеств множества X следующим образом. В первый блок поместим все $(k+1)$ -элементные подмножества, содержащие элемент x_{n+1} . Такие подмножества элемент x_{n+1} гарантированно содержат. Нам из оставшихся элементов $x_1, \dots, x_n$ множества $X \setminus x_{n+1}$ нужно выбрать недостающие k элементов. По определению биномиального коэффициента, сделать мы это можем $\binom{n}{k}$ способами.

Теперь мы рассмотрим все $(k+1)$ -элементные подмножества, которые не содержат элемент x_{n+1} , но обязательно содержат элемент x_n . Для того, чтобы любое такое подмножество сформировать, нам нужно из множества элементов $\{x_1, \dots, x_{n-1}\}$ выбрать недостающие k элементов. Это можно сделать $\binom{n-1}{k}$ количеством способов.

Затем рассмотрим все $(k+1)$ -элементные подмножества, которые содержат в обязательном порядке элемент x_{n-1} и не содержат элементов x_{n+1} и x_n . Эти подмножества получаются выбором недостающих k элементов из множества элементов $\{x_1, \dots, x_{n-2}\}$, и выбрать такие подмножества можно $\binom{n-2}{k}$ способами.

Продолжая далее, мы дойдем когда-то до ситуации, в которой нам нужно выбрать все $(k+1)$ -элементные подмножества, которые содержат элемент x_{k+1} и не содержат элементы со старшими индексами. Так как элемент x_{k+1} у нас уже выбран, то нам остается из множества $\{x_1, \dots, x_k\}$ выбрать k -элементное подмножество. Сделать мы это можем, очевидно, $\binom{k}{k} = 1$ способом.

Складывая теперь количество элементов в каждом блоке, мы и получаем тождество (8).

Пример 2.1. Пусть $n = 4$, $X = \{x_1, x_2, x_3, x_4, x_5\}$, $k = 2$, $k+1 = 3$. Приведем список всех трехэлементных подмножеств этого множества:

$$\begin{array}{ccccccccc}\{x_1, x_2, x_3\}, & \{x_1, x_2, x_4\}, & \{x_1, x_2, x_5\}, & \{x_1, x_3, x_4\}, & \{x_1, x_3, x_5\}, \\ \{x_1, x_4, x_5\}, & \{x_2, x_3, x_4\}, & \{x_2, x_3, x_5\}, & \{x_2, x_4, x_5\}, & \{x_3, x_4, x_5\}.\end{array}$$

В первый блок разбиения этого множества подмножеств включим подмножества, содержащие элемент x_5 ; таковых имеется $\binom{4}{2} = 6$ штук. Из *оставшегося* списка выберем все подмножества, содержащие x_4 ; их $\binom{3}{2} = 3$ штуки. Наконец, у нас остается единственное подмножество элементов, не содержащих ни x_4 , ни x_5 , т.е. подмножество $\{x_1, x_2, x_3\}$.

2.3. Название “биномиальные коэффициенты” связано с тем, что они, помимо всего прочего, встречаются в формуле бинома Ньютона

$$(x + y)^n = \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k y^{n-k}. \quad (9)$$

2.3.1. Комбинаторное доказательство этой формулы довольно элементарно: нужно просто расписать $(x + y)^n$ в виде произведения n сомножителей

$$(x + y)^n = \underbrace{(x + y)}_1 \cdot \underbrace{(x + y)}_2 \cdot \dots \cdot \underbrace{(x + y)}_n$$

и пометить каждый из таких сомножителей числом в диапазоне от единицы до n . В результате мы имеем множество X , состоящее из n различных экземпляров сомножителей вида $(x + y)$.

После перемножения этих n скобок получается определенный набор слагаемых вида $x^k y^{n-k}$, $k = 0, 1, \dots, n$. Для подсчета количества этих слагаемых при фиксированном значении параметра k заметим, что любое слагаемое $x^k y^{n-k}$ можно получить так: выбрать в n -элементном множестве X k -элементное подмножество, взять в этом подмножестве в качестве сомножителей переменные x , а в оставшемся $(n - k)$ -элементном подмножестве выбрать в качестве сомножителей переменные y . Как следствие, количество слагаемых $x^k y^{n-k}$ совпадает с количеством способов выбрать k -элементное подмножество n -элементного множества X и равно $\binom{n}{k}$.

2.3.2. Формула (9) оказывается чрезвычайно полезной для вывода разного рода соотношений, связанных с биномиальными коэффициентами. Например, полагая в ней $x = y = 1$, получаем тождество

$$\sum_{k=0}^n \binom{n}{k} = 2^n. \quad (10)$$

Заметим теперь, что, суммируя биномиальные коэффициенты $\binom{n}{k}$ по k , мы подсчитываем все подмножества n -элементного множества. Иными словами, мы формально доказали тот факт, что количество всех подмножеств данного n -множества равно 2^n . Комбинаторное доказательство этого факта будет дано в следующем параграфе.

2.3.3. Далее, полагая в (9) $x = -1$, $y = 1$, получаем важное тождество

$$\sum_{k=0}^n (-1)^k \binom{n}{k} = 0, \quad n > 0. \quad (11)$$

Заметим, что в случае $n = 0$ эта сумма оказывается равной единице. Для того, чтобы понять комбинаторный смысл равенства (11), перепишем его в следующем виде:

$$\binom{n}{0} - \binom{n}{1} + \binom{n}{2} - \binom{n}{3} + \dots = 0 \quad \Longleftrightarrow \quad \binom{n}{0} + \binom{n}{2} + \dots = \binom{n}{1} + \binom{n}{3} + \dots$$

В левой части последнего равенства стоит количество всех подмножеств, в которых содержится четное количество элементов, а в правой — число подмножеств, содержащих нечетное количество элементов. Иными словами, следствием равенства (11) является тот факт, что количество четных подмножеств любого множества, отличного от $\emptyset$, равняется количеству его нечетных подмножеств.

Наконец, отсюда же мы можем заключить, что количество, например, всех нечетных подмножеств ровно в два раза меньше общего количества всех подмножеств. С учетом (10) это означает, что количество всех нечетных подмножеств равно 2^{n-1} .

2.3.4. Наконец, продифференцируем (9) по x :

$$n(x+y)^{n-1} = \sum_{k=1}^n k \binom{n}{k} x^{k-1} y^{n-k}. \quad (12)$$

Подставляя в это равенство $x = y = 1$, получим еще одно полезное равенство:

$$\sum_{k=1}^n k \binom{n}{k} = n 2^{n-1}.$$

2.4. Перейдем теперь к задачам, связанным с подсчетом k -сочетаний с повторениями.

2.4.1. Начнем с примера. Пусть множество X состоит из двух чисел 1 и 2. Выпишем все 3-сочетания с повторениями из 2-множества X :

$$\{1, 1, 1\}, \quad \{1, 1, 2\}, \quad \{1, 2, 2\}, \quad \{2, 2, 2\}.$$

Как видно, таковых оказалось 4 штуки. Как подсчитать это количество в общем случае?

2.4.2. Для решения данной задачи воспользуемся чрезвычайно полезным и часто используемым в комбинаторике *принципом биекции*. Формально этот принцип можно сформулировать следующим образом: пусть X, Y — пара конечных множеств, и пусть существует биекция $f: X \rightarrow Y$, т.е. такое отображение, что

$$\forall y \in Y \quad \exists! x \in X : \quad y = f(x).$$

Тогда количество элементов в множествах X и Y совпадают: $|X| = |Y| = n$.

2.4.3. Неформально использование принципа биекции можно проиллюстрировать на следующем примере. Предположим, что вы устраиваете вечеринку и приглашаете на нее довольно много друзей. Как гостеприимный хозяин, вы встречаете всех своих друзей на входе в дом, но запоминаете только пришедших к вам девушек. В какой-то момент вы решаете подсчитать, сколько парней пришло к вам на вечеринку. Вы знаете количество пришедших к вам девушек, и вам кажется, что количество девушек и парней одинаково. Как вам быстро проверить это предположение? Ответ достаточно очевиден: попросить каждую девушку взять ровно одного парня за руку. Если в результате этой процедуры все множество гостей разбилось на пары, то ваше предположение окажется верным. Тем самым вы сильно упростили себе жизнь — вам не пришлось проделывать довольно утомительную работу по пересчету пришедших к вам парней; вы просто воспользовались для их подсчета результатом уже проделанной работы по пересчету пришедших к вам девушек.

2.4.4. Вернемся теперь к задаче подсчета всех k -сочетаний с повторениями, т.е. всех k -мультимножеств над n -множеством X . Для подсчета количества $\binom{n}{k}$ таких мультимножеств нам будет удобнее вначале конкретизировать n -множество X , а именно, взять в качестве X множество $[n] := \{1, 2, \dots, n\}$ первых n натуральных чисел. Любое k -мультимножество такого множества можно записать, очевидно, в следующем виде:

$$1 \leq a_1 \leq a_2 \leq \dots \leq a_k \leq n.$$

Например, 3-мультимножество $\{1, 1, 2\}$ над 2-множеством $X = \{1, 2\}$ можно записать так:

$$1 \leq (a_1 = 1) \leq (a_2 = 1) \leq (a_3 = 2) \leq (n = 2).$$

Теперь превратим в этой цепочке все нестрогие неравенства в строгие. Для этого мы к a_2 прибавим единицу, к a_3 — двойку, к a_4 — тройку, и так далее. К последнему числу a_n мы, таким образом, добавим число $(k - 1)$. В результате получим цепочку строгих неравенств вида

$$1 \leq a_1 < a_2 + 1 < a_3 + 2 < a_4 + 3 < \dots < a_k + (k - 1) \leq n + (k - 1).$$

В нашем примере

$$1 \leq (a_1 = 1) < (a_2 + 1 = 2) < (a_3 + 2 = 4) \leq (n + (3 - 1) = 4).$$

Заметим, что в результате этой операции мы получили некоторое k -элементное подмножество *различных* чисел вида $a_i + (i - 1)$ множества $\tilde{X} = [n + k - 1]$ всех чисел от единицы до $n + k - 1$. Иными словами, мы сопоставили любому k -мультимножеству над множеством $X = [n]$ вполне определенное k -подмножество множества $\tilde{X} = [n + k - 1]$. Очевидно, что это сопоставление взаимно-однозначно. Но количество всех k -подмножеств данного множества мы знаем — оно равно $\binom{n+k-1}{k}$. Следовательно, этому числу равно, по принципу биекции, и количество $\binom{n}{k}$ всех k -мультимножеств над множеством $X = [n]$:

$$\binom{\binom{n}{k}}{k} = \binom{n+k-1}{k}.$$

Справедливость этого равенства для произвольного n -элементного множества X вновь следует из принципа биекции.

3 k -перестановки из n элементов. Урновые схемы и схемы раскладки предметов по ящикам.

3.1. Перейдем теперь к подсчету количества k -перестановок из n элементов.

3.1.1. Напомним, что k -перестановкой из n элементов называется *упорядоченный* набор

$$(a_1, a_2, \dots, a_k)$$

элементов, в котором все a_i принадлежат одному и тому же n -элементному множеству X .

Элементы a_i в наборе $(a_1, a_2, \dots, a_k)$ могут как повторяться, так и не повторяться. В первом случае говорят о k -перестановках с повторениями, во втором — о k -перестановках без повторений.

Номер паспорта — это типичный пример k -перестановки с повторениями над множеством из десяти цифр $X = \{0, 1, \dots, 9\}$. Классическим примером 3-перестановки без повторений является упорядоченный список спортсменов, занявших призовые места в любых спортивных соревнованиях.

3.1.2. В литературе встречается довольно много альтернативных названий для данного объекта. Именно, упорядоченный набор $(a_1, a_2, \dots, a_k)$, $a_i \in X$, также иногда называется

- k -размещением из n элементов;
- кортежем из k элементов множества X ;
- упорядоченной k -выборкой из n элементов;
- k -мерным вектором над множеством X ;
- k -элементным словом над n -элементным алфавитом.

3.1.3. Сосчитаем количество k -перестановок с повторениями.

Утверждение 3.1. *Количество k -перестановок с повторениями из n элементов равно n^k .*

Для доказательства можно либо просто сослаться на правило произведения, либо рассмотреть $(a_1, a_2, \dots, a_k)$, $a_i \in X$ как слово из k элементов над алфавитом из $n = |X|$ букв. На первое место в слове мы можем поставить любую из n букв, на второе — также любую из n букв и так далее. Всего же получаем n^k вариантов записать данное слово.

3.1.4. В качестве важного приложения доказанного выше результата сосчитаем еще раз, на этот раз комбинаторно, количество подмножеств данного множества X . Для этого воспользуемся принципом биекции. Именно, закодируем любое подмножество A множества X бинарной строкой $f(A)$ длины n , то есть строкой над алфавитом $\{0, 1\}$. Единицу на i -м месте поставим в случае, если элемент $x_i \in A$. В противном случае на i -е место поставим ноль.

Например, пусть $X = \{x_1, x_2, x_3, x_4\}$, $A = \{x_2, x_4\}$. Тогда соответствующая подмножеству A строка длины 4 записывается следующим образом:

$$f(A) = (0, 1, 0, 1).$$

Очевидно, что построенное отображение f взаимно-однозначно. Следовательно, количество подмножеств данного n -множества X совпадает с количеством бинарных строк длины n , которое, согласно доказанному выше утверждению 3.1, равно 2^n .

3.1.5. Перейдем теперь к подсчету количества перестановок без повторений.

Утверждение 3.2. *Количество $P(n, k)$ k -перестановок из n элементов без повторений равно*

$$P(n, k) = n \cdot (n - 1) \cdot \dots \cdot (n - k + 1) =: (n)_k.$$

Доказательство очевидно — на первое место в строке длины k я могу поставить любой из n элементов, на второе — любой из оставшихся $(n - 1)$ элементов и так далее.

3.1.6. В частном случае $k = n$ k -перестановки из n элементов без повторений называются просто перестановками n -элементного множества X . Их количество равно

$$P_n \equiv P(n) = n!, \quad P(0) = 0! = 1.$$

3.1.7. Любую k -перестановку из n элементов без повторений можно рассматривать и как упорядоченное k -подмножество n -множества. Количество таких подмножеств мы можем сосчитать следующим образом: мы можем $\binom{n}{k}$ способами выбрать k -подмножество n -элементного множества, а затем $k!$ способами его упорядочить. Действительно, на первое место мы можем поставить любой из k элементов подмножества, на второе — любой из оставшихся $k - 1$ элементов

и так далее. Таким образом, мы получаем некоторое новое выражение для количества всех упорядоченных k -элементных подмножеств n -множества, то есть количества k -перестановок из n элементов без повторений, равно

$$(n)_k = k! \cdot \binom{n}{k} \implies \binom{n}{k} = \frac{(n)_k}{k!}.$$

Последняя формула часто используется как некомбинаторное определение биномиальных коэффициентов $\binom{n}{k}$ в случае, когда $k \in \mathbb{Z}$, а n принадлежит $\mathbb{Z}$, $\mathbb{R}$ или даже $\mathbb{C}$. Именно, по определению,

$$\binom{q}{k} := \begin{cases} \frac{q(q-1) \dots (q-k+1)}{k!} =: \frac{(q)_k}{k!}, & \text{если } k \in \mathbb{N}, \\ 1, & \text{если } k = 0, \\ 0, & \text{если } k < 0, \end{cases} \quad \forall q \in \mathbb{C}.$$

Например,

$$\binom{-1}{3} = \frac{(-1) \cdot (-2) \cdot (-3)}{3 \cdot 2 \cdot 1} = -1.$$

3.1.8. Функцию $(q)_k$ часто также обозначают через $q^{\bar{k}}$ и называют *убывающей факториальной степенью* [?]. Наряду с убывающей можно ввести и так называемую *возрастающую факториальную степень*

$$q^{(k)} \equiv q^{\bar{k}} := q \cdot (q+1) \cdot \dots \cdot (q+k-1).$$

В частности, с ее помощью получается удобное для вычислений выражение для количества $\binom{n}{k}$ сочетаний с повторениями:

$$\binom{\binom{n}{k}}{k} = \binom{n+k-1}{k} = \frac{n^{(k)}}{k!}. \quad (13)$$

3.2. Итак, мы получили простые соотношения для подсчета количества четырех основных объектов элементарной комбинаторики — k -сочетаний и k -перестановок из n элементов с повторениями и без повторений. Эти объекты встречаются в огромном количестве внешне не очень похожих друг на друга задач элементарной комбинаторики. Оказывается, однако, что большинство этих задач можно свести к одной из двух простейших схем — либо к так называемой урновой схеме, либо к схеме раскладки предметов по ящикам.

3.2.1. В урновой схеме имеется урна, в которой находятся n *различимых* предметов. Из урны последовательно вытаскивается k предметов. Задача состоит в подсчете количества различных способов выбора этих предметов, или, как еще говорят, в подсчете различных k -элементных выборок из n предметов, находящихся в урне.

На практике наиболее часто встречаются четыре модификации этой задачи, различающиеся способами формирования k -элементной выборки. Прежде всего, мы можем возвращать или не возвращать вытаскиваемые предметы обратно в урну. В первом случае говорят о *выборке с повторениями*, во втором — о *выборке без повторений*. Далее, в некоторых задачах нам важен порядок вытаскиваемых предметов. В этом случае имеем так называемые *упорядоченные* выборки. В противном случае выборки называются *неупорядоченными*.

Нетрудно понять, что задачи о подсчете k -элементных выборок представляют собой, по сути, те же самые задачи о подсчете k -перестановок или k -сочетаний из n элементов. Действительно,

любая неупорядоченная k -элементная выборка представляет собой либо k -элементное подмножество n -множества, либо k -мультимножество над n -элементным множеством в зависимости от того, возвращаем мы вытаскиваемые предметы обратно в урну или не возвращаем. Следовательно, количество таких неупорядоченных выборок совпадает с коэффициентами $\binom{n}{k}$ или $\left(\!\!\binom{n}{k}\!\!\right)$. Очевидно также, что любая упорядоченная k -элементная выборка есть просто некоторая k -перестановка n -элементного множества. Поэтому количество таких выборок равно n^k или $(n)_k$ в зависимости от того, говорим ли мы о выборке с повторениями или без повторений.

В результате получаем следующую таблицу решений задач, связанных с урновыми схемами:

Предметы на выходе	с возвращением	без возвращения
упорядоченные	n^k	$(n)_k$
неупорядоченные	$\left(\!\!\binom{n}{k}\!\!\right)$	$\binom{n}{k}$

3.2.2. Приведем несколько характерных примеров, достаточно естественно сводящихся к одной из описанных выше урновых схем.

Пример 3.3. Предположим, что у нас имеется некоторое общество, состоящее из двадцати членов. Сколькими способами можно выбрать президента, вице-президента, секретаря и казначея этого общества?

Решение. Очевидно, что любой способ выбора представляет собой упорядоченное 4-элементное подмножество 20-элементного множества. Следовательно, существует ровно $(20)_4$ различных способов выбора членов общества на эти должности.

Пример 3.4. Для того, чтобы открыть сейф, нужно набрать код из пяти символов с помощью вращающихся дисков. На каждом из этих дисков нанесено 12 символов, одинаковых для каждого из дисков. Сколько вариантов различных кодов существует?

Решение. Любой код представляет собой упорядоченную 5-элементную выборку с повторениями или, иначе, строку из пяти символов над алфавитом из 12 букв. Следовательно, имеется 12^5 вариантов различных кодов.

Пример 3.5. На почте продаются открытки десяти различных видов. Сколькими способами можно купить восемь открыток? А восемь открыток разных видов?

Решение. Понятно, что в первом случае любой набор из восьми открыток представляет собой неупорядоченную выборку с повторениями, а во втором — выборку без повторений из 10 элементов. Следовательно, в первом случае имеем $\left(\!\!\binom{10}{8}\!\!\right)$, а во втором — $\binom{10}{8}$ способов покупки восьми открыток.

3.2.3. Второй, не менее популярной в элементарной комбинаторике схемой, связанной с подсчетом количества k -перестановок и k -сочетаний, является схема раскладки предметов по ящикам. В этой схеме имеется n различных ящиков, по которым нужно разложить k различных или неразличимых предметов. При этом мы можем накладывать определенные ограничения на количество предметов в каждом ящике.

Рассмотрим, к примеру, задачу о подсчете количества способов раскладки k различных предметов по n различным ящикам при условии, что в любой ящик можно класть любое количество

предметов. Количество способов совершить эти действия равно, очевидно, n^k . Действительно, любой предмет мы можем положить в любой из n ящиков вне зависимости от того, куда мы положили оставшиеся предметы. Поэтому, согласно правилу произведения, это количество равно n^k . Иными словами, данная задача представляет собой переформулировку задачи о подсчете количества k -перестановок из n элементов с повторениями.

Теперь предположим, что в той же схеме мы не имеем права класть более одного предмета в один ящик. Тогда первый предмет мы можем поместить в любой из n ящиков, второй — в любой из оставшихся свободными $(n - 1)$ ящиков и так далее. Всего же получаем $(n)_k$ способов раскладки. Следовательно, данная схема соответствует подсчету k -перестановок без повторений.

3.2.4. Пусть теперь у нас имеются n различных ящиков и k неразличимых предметов. Тогда подсчет количества различных способов раскладки этих предметов по ящикам сводится к задаче о подсчете количества k -сочетаний из n элементов.

Действительно, в данной схеме в качестве n -элементного множества выступает множество, состоящее из n различных ящиков. В случае, когда в каждый ящик можно класть не более одного предмета, мы, раскладывая предметы по ящикам, выделяем в этом множестве некоторое k -элементное подмножество. Следовательно, количество таких раскладок совпадает с количеством различных k -элементных подмножеств n -множества и равно $\binom{n}{k}$.

В случае же, когда никаких ограничений на количество предметов в ящике не накладывается, мы, раскладывая по ящикам k неразличимых предметов, задаем тем самым некоторое k -мультимножество n -множества X . Поэтому количество различных способов такой раскладки равно количеству $\binom{n+k-1}{k}$ k -сочетаний из n элементов с повторениями.

Подводя итоги, построим таблицу рассмотренных схем раскладок n предметов по k ящикам:

Предметы	Ящики	Произвольное количество предметов в ящике	Не более одного предмета в ящике
различные	различные	n^k	$(n)_k$
неразличимые	различные	$\binom{n+k-1}{k}$	$\binom{n}{k}$

3.2.5. Проиллюстрируем некоторые характерные примеры задач, которые довольно естественно сводятся к схеме схем раскладки предметов по ящикам.

Пример 3.6. Сколькими способами можно разложить по двум *различимым* карманам (например, левому и правому) девять монет *различного* достоинства?

Решение. Рассматриваемый пример является типичной задачей, которая естественным образом сводится к схеме раскладки предметов по ящикам. Действительно, в роли ящиков здесь выступают левый и правый карман, а в роли предметов — девять различных монет. Поэтому ответ в этой задаче — 2^9 способов.

Замечание 3.7. Рассмотренная задача, однако, не всегда решается верно: в качестве ответа иногда выдают 9^2 способов. Путаница, как правило, происходит потому, что эту задачу пыта-

ются свести к урновой схеме, считая, что имеются урна, в которой расположены 9 различных предметов, а также 2 различимые позиции на выходе.

Для того, чтобы этой путаницы избежать, полезно сформулировать следующие основные отличия схемы раскладки по ящикам от соответствующей ей урновой схемы. Во-первых, в схеме раскладки предметов по ящикам предметы обратно не возвращаются, они остаются в ящике. Во-вторых, в этой схеме в любой ящик можно класть любое количество предметов. В аналогичной урновой схеме на любую позицию помещается ровно один предмет.

Приведем теперь два характерных примера, связанных с раскладкой неразличимых предметов по различимым ящикам.

Пример 3.8. У отца имеется 5 (неразличимых) апельсинов, которые он может раздать восьми своим сыновьям. Если его задача состоит в том, чтобы раздать их максимальному количеству сыновей, то он должен поставить дополнительное условие — любой из его сыновей не должен получить более одного апельсина. В этом случае количество способов, которыми он может раздать своим сыновьям эти пять апельсинов, равно, очевидно, $\binom{8}{5}$. Если же он раздает их по каким-то заслугам, и может, таким образом, любому сыну отдать любое количество апельсинов, то количество способов это сделать равно $\left(\binom{8}{5}\right) = \binom{12}{5}$.

Пример 3.9. В физике встречаются задачи, в которых имеются n различных уровней энергии и k неразличимых элементарных частиц. Если эти частицы — фермионы, то для них действует так называемый принцип запрета Паули, согласно которому на любом энергетическом уровне может находиться не более одной элементарной частицы. Как следствие, количество различных распределений k фермионов по n энергетическим уровням равно $\binom{n}{k}$. Наряду с фермионами существуют и частицы иного сорта — бозоны, для которых не существует ограничений на количество частиц, занимающих один и тот же уровень энергии. Для бозонов количество таких распределений равно, очевидно, $\left(\binom{n}{k}\right)$.

3.2.6. К задачам раскладки неразличимых предметов по различимым ящикам, связанным с подсчетом количества k -сочетаний, сводятся также задачи о так называемом *разбиении* натурального числа k на n слагаемых. Данная задача формулируется следующим образом: сколькими способами можно представить натуральное число k в виде суммы n слагаемых вида

$$a_1 + a_2 + \dots + a_n = k$$

при условии, что порядок слагаемых важен, то есть при условии, что разбиения вида

$$1 + 3 + 3 + 3 = 10 \quad \text{и} \quad 3 + 1 + 3 + 3 = 10$$

считаются различными?

Если на числа a_i накладывается единственное условие вида $a_i \geq 0$, то количество разбиений равно количеству $\left(\binom{n}{k}\right)$ k -мультимножеств над n -элементным множеством. Действительно, в упорядоченной сумме $a_1 + a_2 + \dots + a_n$ любой индекс i слагаемого a_i можно рассматривать как i -й ящик, в который мы складываем a_i единиц. Следовательно, эту задачу можно трактовать как задачу о раскладке k “неразличимых” единиц по n различимым ящикам.

Пример 3.10. Подсчитать количество разбиений числа $k = 4$ на два слагаемых:

$$a_1 + a_2 = 4, \quad a_1, a_2 \geq 0.$$

Ответ: $\binom{2}{4} = \binom{5}{4} = 5$ разбиений: $0 + 4 = 1 + 3 = 2 + 2 = 3 + 1 = 4 + 0 = 4$.

К подсчету числа k -сочетаний из n элементов без повторений задача о разбиении числа k сводится в случае, когда на числа a_i накладываются следующие условия:

$$a_i = 0 \quad \text{или} \quad a_i = 1.$$

В этом случае индекс i также можно трактовать как i -й ящик; его можно выбрать (положив $a_i = 1$) или не выбрать (положив $a_i = 0$). Всего же нужно выбрать k таких ящиков. Это можно сделать $\binom{n}{k}$ способами.

Пример 3.11. Подсчитать количество разбиений числа 2 на три слагаемых при условии, что любое слагаемое может принимать значения 0 или 1.

Ответ: $\binom{3}{2} = 3$ разбиения: $1 + 1 + 0 = 1 + 0 + 1 = 0 + 1 + 1 = 2$.

3.2.7. Достаточно часто на практике встречаются ситуации, когда одну и ту же задачу можно свести и к урновой схеме, и к схеме раскладки предметов по ящикам.

Пример 3.12. В кондитерском магазине продаются пирожные трех разных видов. Сколькими различными способами можно купить семь пирожных?

Решение. Ответ в этой задаче, очевидно, равен $\binom{3}{7} = \binom{9}{7}$. Этот ответ можно, например, получить, представляя себе коробку с тремя отделениями, в каждое из которых кладется пирожное только одного вида; в этом случае мы сводим задачу к подсчету количества раскладок семи неразличимых предметов по трем различным ящикам. Другой способ получить тот же ответ — это представлять себе урну, в которой находятся три разных пирожных, и считать количество способов выбора из урны семи пирожных с возвращениями любого выбранного пирожного обратно в урну. Наконец, можно вообще забыть о любых схемах, если понимать, что любые семь купленных пирожных трех различных видов представляют собой 7-мультимножество над 3-элементным множеством различных видов пирожных.

4 Подсчет количества отображений конечных множеств. Числа Стирлинга второго рода

4.1. Оказывается, задачи о раскладке различных предметов по различным же ящикам имеют и еще одну, чрезвычайно важную комбинаторную интерпретацию — они эквивалентны задачам о подсчете количества отображений конечных множеств.

4.1.1. Напомним определение произвольного отображения $f: X \rightarrow Y$.

Определение 4.1. Пусть X, Y — пара конечных множеств. Отображением f из X в Y называется правило, согласно которому любому элементу $x \in X$ ставится в соответствие единственный элемент $y \in Y$:

$$\forall x \in X \quad \exists! y \in Y: \quad y = f(x).$$

С комбинаторной точки зрения любое отображение f из n -элементного множества X в k -элементное множество Y можно рассматривать как некоторый вариант раскладки n различных предметов по k различным ящикам при отсутствии каких-либо ограничений на количество предметов в каждом ящике.

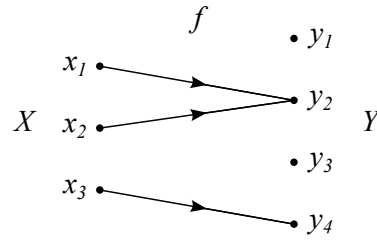


Рис. 6

Пример 4.2. Рассмотрим отображение f из трехэлементного множества X в четырехэлементное множество Y вида

$$f(x_1) = y_2, \quad f(x_2) = y_2, \quad f(x_3) = y_4$$

(смотри рис.6). Этому отображению отвечает раскладка трех различных предметов по четырем различным ящикам, при которой первые два предмета размещаются во втором ящике, а третий предмет — в четвертом ящике.

Как следствие, общее количество всех отображений n -элементного множества X в k -элементное множество Y равно k^n .

4.1.2. Напомним теперь определение *инъективного* отображения.

Определение 4.3. Отображение $f: X \rightarrow Y$ называется инъективным, если из условия

$$f(x_1) = f(x_2) \quad \implies \quad x_1 = x_2.$$

Иными словами, отображение называется инъективным, если у любого элемента $y \in Y$ имеется не более одного прообраза, т.е. элемента $x \in X$, такого, что $y = f(x)$.

Понятно, что любому инъективному отображению $f: X \rightarrow Y$ отвечает такая раскладка n элементов множества X , при которой в каждом из k ящиков находится не более одного элемента. Как следствие, количество всевозможных инъективных отображений равно $(k)_n$.

4.1.3. Наконец, рассмотрим случай биективного и сюръективного отображений.

Определение 4.4. Отображение $f: X \rightarrow Y$ называется *биективным*, если

$$\forall y \in Y \quad \exists! x \in X: \quad y = f(x).$$

Количество таких отображений равно, очевидно, $n!$, где $n = |X| = |Y|$.

Определение 4.5. Отображение $f: X \rightarrow Y$ называется *сюръективным*, если

$$\forall y \in Y \quad \exists x \in X: \quad y = f(x).$$

Другими словами, отображение f сюръективно, если у любого элемента $y \in Y$ найдется хотя бы один прообраз $x \in X$, то есть такой x , что $f(x) = y$.

Комбинаторная интерпретация сюръективного отображения такова: это есть некоторая раскладка n различных предметов по k различным ящикам при условии, что в каждом ящике находится хотя бы один предмет. Количество таких раскладок при $k > n$ равно, очевидно,

нулю. Задача следующего пункта данного параграфа — сосчитать количество этих раскладок для случая $0 \leq k \leq n$.

4.2. Обозначим через $\widehat{S}(n, k)$ количество всех сюръективных отображений n -элементного множества X в k -элементное множество Y . Сосчитаем $\widehat{S}(n, k)$ для случая $n \geq 0, 0 \leq k \leq n$.

4.2.1. Рассмотрим множество *всех* отображений из n -множества X в k -множество Y . Как мы знаем, количество таких отображений равно k^n . Наша задача состоит в том, чтобы подсчитать это количество по-другому, выразив k^n через числа $\widehat{S}(n, k)$.

4.2.2. Заметим, что *любое* отображение $f: X \rightarrow Y$ можно рассматривать как *сюръективное* отображение множества X на множество

$$\text{Im}(f) = \{y \in Y \mid \exists x: y = f(x)\},$$

являющееся образом множества X при отображении f .

Так, для отображения f из примера 4.2 образ $\text{Im}(f) = \{y_2, y_4\}$, а отображение $f: X \rightarrow Y$ является сюръективным отображением множества X на подмножество $\text{Im}(f) \subset Y$.

4.2.3. Разобьем теперь все множество отображений $f: X \rightarrow Y$ на блоки, включив в i -й блок все отображения, образ $\text{Im}(f)$ которых содержит ровно i элементов: $|\text{Im}(f)| = i, i = 1, \dots, k$. Все, что нам остается — это сосчитать количество элементов в каждом блоке, а затем воспользоваться правилом суммы для того, чтобы получить общее количество k^n всех отображений.

4.2.4. Заметим, что существует $\binom{k}{i}$ способов выбрать i -элементное подмножество k -множества Y . Для каждого из этих подмножеств имеется $\widehat{S}(n, i)$ различных сюръективных отображений из n -элементного множества X в выбранное i -элементное подмножество множества Y . Таким образом, по правилу произведения, общее количество элементов в i -м блоке равно

$$\binom{k}{i} \cdot \widehat{S}(n, i).$$

Тогда по правилу суммы можем записать, что

$$k^n = \sum_{i=0}^k \binom{k}{i} \cdot \widehat{S}(n, i). \quad (14)$$

При этом мы суммируем не от 1 до k , а от 0 до k , учитывая, что $\widehat{S}(n, 0) = 0$ для всех $n > 0$.

Замечание 4.6. Формулу (14) полезно иногда записывать в виде

$$k^n = \sum_{i=0}^n \binom{k}{i} \cdot \widehat{S}(n, i). \quad (15)$$

Несложно убедиться в том, что эта формула непосредственно следует из (14), а также в том, что она оказывается справедливой как для случая $n \geq k$, так и для случая $n < k$.

4.2.5. Мы выразили количество всех отображений n -элементного множества X в k -элементное множество Y через количество $\widehat{S}(n, i)$ сюръективных отображений. Нам же нужна обратная формула, выражающая количество $\widehat{S}(n, k)$ сюръективных отображений через число i^n всех отображений. Для ее получения воспользуемся так называемыми *формулами обращения*.

Утверждение 4.7. Пусть $(f_0, f_1, f_2, \dots)$ и $(g_0, g_1, g_2, \dots)$ — две числовые последовательности, и пусть одна из них выражается через вторую по формулам

$$f_k = \sum_{i=0}^k \binom{k}{i} g_i, \quad k \geq 0. \quad (16)$$

Тогда справедлива следующая формула обращения:

$$g_k = \sum_{i=0}^k (-1)^{k-i} \binom{k}{i} f_i, \quad k \geq 0. \quad (17)$$

С учетом этих формул обращения можно, считая n параметром, из соотношения (14) получить следующую явную формулу для вычисления чисел $\hat{S}(n, k)$:

$$\hat{S}(n, k) = \sum_{i=0}^k (-1)^{k-i} \binom{k}{i} \cdot i^n.$$

4.3. Задачи подсчета количества отображений n -элементного множества X в k -элементное множество Y имеют еще одну важную комбинаторную интерпретацию.

4.3.1. Начнем с простого примера.

Пример 4.8. Для трехэлементного множества $X = \{x_1, x_2, x_3\}$ и двухэлементного множества $Y = \{y_1, y_2\}$ имеется, как мы знаем, $2^3 = 8$ различных отображений множества X в множество Y . Запишем все эти отображения как упорядоченные пары подмножеств множества X :

$$\begin{aligned} &(\{x_1, x_2, x_3\}, \emptyset), \quad (\{x_1, x_2\}, \{x_3\}), \quad (\{x_1, x_3\}, \{x_2\}), \quad (\{x_2, x_3\}, \{x_1\}), \\ &(\{x_1\}, \{x_2, x_3\}), \quad (\{x_2\}, \{x_1, x_3\}), \quad (\{x_3\}, \{x_1, x_2\}), \quad (\emptyset, \{x_1, x_2, x_3\}). \end{aligned}$$

Видно, что записанное в таком виде решение представляет собой не что иное, как список всех возможных *разделений* множества X , то есть упорядоченных разбиений X на два блока, один из которых может быть и пустым.

4.3.2. Очевидно, что данный результат справедлив и в общем случае. Именно, любое отображение $f: X \rightarrow Y$ задает нам некоторое разделение множества X , то есть разбиение этого множества на k упорядоченных блоков, часть из которых могут быть пустыми. Как следствие, количество таких разделений совпадает с количеством всех отображений f и равно k^n .

Аналогичные рассуждения показывают, что любое сюръективное отображение $f: X \rightarrow Y$ задает нам некоторое *упорядоченное разбиение* множества X на блоки. Поэтому количество всех упорядоченных разбиений n -элементного множества X на k блоков равно числу $\hat{S}(n, k)$.

4.3.3. Рассмотрим теперь некоторый специальный вид k -разделений множества X , а именно, такие k -разделения, в которых в первом блоке содержится a_1 элемент, во втором блоке — a_2 элемента, в k -м блоке — a_k элементов. Очевидно, что при этом общая сумма всех элементов должна быть равна мощности $|X| = n$:

$$a_1 + a_2 + \dots + a_k = n, \quad a_i \geq 0.$$

Утверждение 4.9. *Количество всех таких k -разделений n -множества X равно*

$$P(n; a_1, a_2, \dots, a_k) := \binom{n}{a_1} \cdot \binom{n-a_1}{a_2} \cdot \dots \cdot \binom{n-a_1-a_2-\dots-a_{k-1}}{a_k} = \frac{n!}{a_1! \cdot a_2! \cdot \dots \cdot a_k!}. \quad (18)$$

Доказательство. Действительно, из любого n -элементного множества X мы $\binom{n}{a_1}$ способами можем выбрать a_1 элементов и положить их в первый ящик (отнести к первому блоку разбиения). Затем для каждого такого выбора мы $\binom{n-a_1}{a_2}$ способами можем из оставшегося $(n - a_1)$ -элементного множества выбрать a_2 элементов и положить их во второй ящик (отнести ко второму блоку разбиения), и так далее. Формула (18), описывающая общее количество способов совершить все эти действия, следует теперь из правила произведения. $\square$

Следствие 4.10. *Общее количество k^n всех k -разделений n -множества X выражается через числа $P(n; a_1, a_2, \dots, a_k)$ по формуле*

$$k^n = \sum_{\substack{a_1+a_2+\dots+a_k=n \\ a_i \geq 0}} P(n; a_1, a_2, \dots, a_k) = \sum_{\substack{a_1+a_2+\dots+a_k=n \\ a_i \geq 0}} \frac{n!}{a_1! \cdot a_2! \cdot \dots \cdot a_k!}. \quad (19)$$

Замечание 4.11. Если в условии рассматриваемой задачи заменить нестрогие неравенства $a_i \geq 0$ на строгие, то есть на неравенства $a_i > 0$, то вместо деления мы получим упорядоченное разбиение специального вида. Количество таких упорядоченных разбиений также описывается формулой (18), а вместо формулы (19) получается не менее полезное соотношение вида

$$\hat{S}(n, k) = \sum_{\substack{a_1+a_2+\dots+a_k=n \\ a_i > 0}} \frac{n!}{a_1! \cdot a_2! \cdot \dots \cdot a_k!}. \quad (20)$$

4.4. Числа $P(n; a_1, a_2, \dots, a_k)$ имеют и еще один важный комбинаторный смысл. Именно, они перечисляют так называемые *перестановки n -множества X с повторениями*.

4.4.1. Рассмотрим в качестве элементарного примера следующую задачу: на полке имеются 15 различных книг по математике, 16 по информатике и 12 по физике; каково количество способов перестановки этих книг на полке? Ответ очевиден: $(15 + 16 + 12)! = 43!$ способов.

Предположим теперь, что мы перестали различать книги, посвященные одному и тому же предмету. В этом случае количество различных способов перестановки таких книг уменьшится. Обозначим это количество через λ_n . Так как существует $15!$ способов упорядочить книги по математике, $16!$ – по информатике и $12!$ – по физике, то по правилу произведения мы можем записать, что

$$43! = \lambda_n \cdot 16! \cdot 15! \cdot 12! \quad \implies \quad \lambda_n = \frac{43!}{16! \cdot 15! \cdot 12!} = P(43; 15, 16, 12).$$

4.4.2. Аналогичные рассуждения справедливы и в общем случае. Именно, пусть среди n переставляемых предметов имеется a_1 неразличимых предметов первого сорта, a_2 неразличимых предметов второго сорта и так далее, причем $a_1 + a_2 + \dots + a_k = n$. Тогда для количества перестановок таких предметов с повторениями получаем уже знакомую нам формулу

$$\frac{n!}{a_1! \cdot a_2! \cdot \dots \cdot a_k!} = P(n; a_1, a_2, \dots, a_k).$$

4.4.3. В частном случае перестановки n предметов двух различных сортов получаем

$$P(n; k, n - k) = \frac{n!}{k! \cdot (n - k)!} = \binom{n}{k}.$$

Иными словами, количество таких перестановок совпадает с количеством различных k -элементных подмножеств n -элементного множества. Для комбинаторного доказательства данного факта можно воспользоваться рассуждениями, которые мы проводили при подсчете количества всех подмножеств данного множества. Напомним, что там мы любое подмножество кодировали упорядоченной битовой строкой длины n , состоящей из k единиц и $(n - k)$ нулей. Осталось заметить, что любая такая строка представляет собой некоторую перестановку k элементов первого сорта (единиц) и $(n - k)$ элементов второго сорта (нулей).

4.4.4. В заключение отметим еще одну полезную биекцию, позволяющую несколько по-другому сосчитать количество k -мультимножеств n -элементного множества. Мы знаем, что любому k -мультимножеству над n -множеством отвечает некоторая раскладка k неразличимых предметов по n различным ящикам. В свою очередь, любую такую раскладку можно рассматривать как упорядоченный набор, состоящий из k неразличимых предметов одного сорта (например, k неразличимых шаров), и $(n - 1)$ -го предмета второго сорта ($(n - 1)$ -й неразличимой перегородки между этими шарами). Как следствие, количество всех k -мультимножеств

$$\left(\binom{n}{k} \right) = P(k + n - 1; k, n - 1) = \frac{(n + k - 1)!}{(n - 1)! \cdot k!} = \binom{n + k - 1}{k}.$$

4.5. Вернемся к числам $\widehat{S}(n, k)$, описывающим, в частности, количество всех упорядоченных разбиений n -множества на k блоков. Обозначим теперь через $S(n, k)$ количество обычных, неупорядоченных разбиений n -множества на k блоков. Так как для любого неупорядоченного разбиения существует $k!$ способов упорядочить k его блоков, то

$$\widehat{S}(n, k) = k! S(n, k).$$

Отсюда с учетом (14) и (20) получаем следующие две явные формулы, позволяющие вычислять числа $S(n, k)$:

$$S(n, k) = \frac{1}{k!} \sum_{i=0}^k (-1)^k \binom{k}{i} (k - i)^n = \frac{1}{k!} \sum_{\substack{a_1 + a_2 + \dots + a_k = n \\ a_i > 0}} \frac{n!}{a_1! \cdot a_2! \cdot \dots \cdot a_k!}. \quad (21)$$

Числа $S(n, k)$ называются *числами Стирлинга второго рода* и встречаются в большом количестве комбинаторных приложений. Исследуем эти числа поподробнее.

4.5.1. Для практического расчета чисел $S(n, k)$ удобно использовать рекуррентные соотношения.

Утверждение 4.12. Числа Стирлинга второго рода удовлетворяют следующим рекуррентным соотношениям:

$$S(n, k) = S(n - 1, k - 1) + k \cdot S(n - 1, k), \quad k = 1, \dots, n; \quad (22)$$

$$S(0, 0) = 1; \quad S(n, 0) = 0 \quad \forall n > 0; \quad S(n, k) = 0 \quad \forall k > n.$$

Доказательство. Граничные условия $S(n, 0) = 0$ для всех $n > 0$ и $S(n, k) = 0$ для всех $k > n$ очевидны — n -элементное множество в случае $n > 0$ нельзя разбить на 0 блоков, а также на k блоков в случае, когда $k > n$. Равенство $S(0, 0) = 1$ введено просто для удобства.

Докажем теперь соотношение (22). Разобьем для этого множество всех k -разбиений на два блока. К первому блоку Σ_1 отнесем все разбиения, содержащие одноэлементное подмножество $\{x_1\}$. Ко второму блоку Σ_2 отнесем все оставшиеся k -разбиения, т.е. разбиения, в которых элемент x_1 входит в подмножества, содержащие как минимум два элемента.

Рассмотрим, к примеру, все 2-разбиения множества $X = \{x_1, x_2, x_3, x_4\}$:

$$\{\{x_1, x_2, x_3\}, \{x_4\}\}, \quad \{\{x_1, x_2, x_4\}, \{x_3\}\}, \quad \{\{x_1, x_3, x_4\}, \{x_2\}\}, \quad \{\{x_2, x_3, x_4\}, \{x_1\}\}, \\ \{\{x_1, x_2\}, \{x_3, x_4\}\}, \quad \{\{x_1, x_3\}, \{x_2, x_4\}\}, \quad \{\{x_1, x_4\}, \{x_2, x_3\}\}.$$

Для этого примера к первому блоку относится единственное разбиение вида $\{\{x_2, x_3, x_4\}, \{x_1\}\}$. Остальные шесть разбиений относятся в данном случае ко второму блоку.

Довольно очевидно, что количество элементов в первом блоке равно количеству $S(n - 1, k - 1)$ всех $(k - 1)$ -разбиений оставшегося $(n - 1)$ -элементного множества. В примере это число равно $S(3, 1) = 1$ — любое множество можно только одним способом разбить на один блок.

Для подсчета количества элементов во втором блоке заметим, что, по сути дела, это число равно количеству всевозможных разбиений $(n - 1)$ -элементного множества на k непустых подмножеств с поочередным добавлением элемента x_1 в каждое из этих подмножеств. Действительно, для разобранный выше примера имеется три разбиения трехэлементного множества $\{x_2, x_3, x_4\}$ на два непустых подмножества, а именно, разбиения вида

$$\{\{x_2\}, \{x_3, x_4\}\}, \quad \{\{x_3\}, \{x_2, x_4\}\}, \quad \{\{x_4\}, \{x_2, x_3\}\}.$$

Добавляя к каждому из этих подмножеств элемент x_1 , получим $2 \cdot 3 = 6$ выписанных выше разбиений четырехэлементного множества X на блоки требуемого вида. Количество таких разбиений в общем случае равно, очевидно, $k \cdot S(n - 1, k)$. $\square$

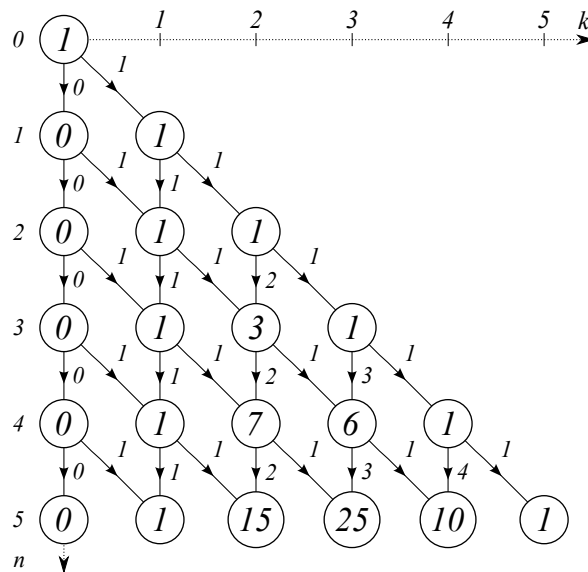


Рис. 7: Графическое представление чисел $S(n, k)$

4.5.2. Как и биномиальные коэффициенты, числа Стирлинга второго рода удобно представлять в виде треугольного массива на плоскости (n, k) . На рис.7 показаны первые несколько строк такого массива, вычисленных с помощью рекуррентных соотношений (22). Такой рисунок дает нам еще одну комбинаторную интерпретацию чисел $S(n, k)$ — это есть количество *взвешенных* путей, идущих из начала координат в точку с координатами (n, k) .

4.5.3. Числа Стирлинга второго рода встречается в очень большом количестве самых разнообразных задач. В качестве примера вернемся к формуле (15) и перепишем ее через числа Стирлинга второго рода:

$$k^n = \sum_{i=0}^n \binom{k}{i} \cdot i! \cdot S(n, i) = \sum_{i=0}^n (k)_i \cdot S(n, i). \quad (23)$$

Оказывается, эта формула справедлива для любых вещественных и даже комплексных значений k . Именно, справедливо равенство

$$x^n = \sum_{i=0}^n (x)_i \cdot S(n, i).$$

Эта формула активно используется в теории конечных операторов — она позволяет перейти от базиса x^n к базису $(x)_n$.

4.5.4. С точки зрения схемы раскладки предметов по ящикам числа Стирлинга второго рода описывают количество способов разложить n различных предметов по k неразличимым ящикам так, чтобы в любом ящике содержался хотя бы один предмет. Сосчитаем, зная $S(n, k)$, количество $B(n, k)$ различных раскладок n различных предметов по k неразличимым ящикам в случае, когда ограничения на количество предметов в любом ящике отсутствуют.

Для этого вновь разобьем множество всех таких раскладок на блоки, поместив в i -й блок все раскладки, в которых занято ровно i ящиков. В случае различных ящиков в процессе аналогичного разбиения множества на блоки мы в i -м блоке имели $\binom{k}{i} \cdot \hat{S}(n, i)$ элементов. В случае неразличимых ящиков мы i из k ящиков выбираем ровно одним способом, а затем $S(n, i)$ способами заполняем эти ящики n предметами. Используя правило суммы, получаем отсюда следующее выражение для чисел $B(n, k)$:

$$B(n, k) = \sum_{i=1}^k S(n, i).$$

4.5.5. Числа $B(n, k)$ в случае $n = k$ называются числами Белла $B(n)$. Эти числа перечисляют количество *всех* возможных разбиений n -элементного множества X .

Заметим, что любое разбиение множества X можно получить, введя на этом множестве некоторое отношение эквивалентности. Как следствие, количество всех возможных отношений эквивалентности на n -элементном множестве X описывается числами Белла B_n .

4.5.6. Покажем, что для чисел Белла $B(n)$ справедливо следующее рекуррентное соотношение:

$$B_{n+1} = \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} B_k. \quad (24)$$

Действительно, рассмотрим блок разбиения $(n+1)$ -элементного множества, содержащий число $n+1$. Все возможные разбиения мы можем разбить на $n+1$ группу (блок) в зависимости от

того, сколько чисел содержится вместе с $n + 1$. Предположим, что вместе с $n + 1$ находятся i чисел, $i = 0, \dots, n$. Эти числа мы можем выбрать $\binom{n}{i} = \binom{n}{n-i}$ способами. Оставшиеся $k = n - i$ чисел, $k = 0, \dots, n$, мы можем $B(k)$ способами разбить на блоки. Суммируя по всем k , мы и получим формулу (24).

4.6. Подведем итоги, построив таблицу различных схем раскладок n предметов по k ящикам:

Элементы множества X (предметы)	Элементы множества Y (ящики)	Произвольное количество предметов в ящике	Не более 1 предмета в ящике	Как минимум 1 предмет в ящике
различимые	различимые	k^n	$(k)_n$	$\hat{S}(n, k)$
неразличимые	различимые	$\left(\begin{smallmatrix} k \\ n \end{smallmatrix}\right)$	$\binom{k}{n}$	$\binom{n-1}{k-1}$
различимые	неразличимые	$B(n, k)$	$0, \quad n > k$ $1, \quad n \leq k$	$S(n, k)$

Как видно, остался еще один неразобранный вариант — схема размещения n неразличимых предметов по k неразличимым ящикам. Для количества таких размещений явных аналитических формул не существует. Для того, чтобы их перечислить, необходимо использовать аппарат производящих функций, к изучению которого мы приступим в одном из следующих параграфов.

5 Рекуррентные соотношения

5.1. Мы уже несколько раз получали решения комбинаторных задач, записанные в виде тех или иных рекуррентных соотношений. Настало время поговорить о них немного поподробнее.

5.1.1. Начнем с простого примера [?].

Пример 5.1. Популяция лягушек в озере увеличивается в четыре раза каждый год. В последний день каждого года 100 лягушек отлавливают и переправляют на другие озера. Предполагая, что в начале первого года в озере было 50 лягушек, найти количество лягушек в начале любого последующего года.

Решение. Обозначим через a_n количество лягушек в начале $(n + 1)$ -го года. По условию задачи, $a_0 = 50$. Тогда, очевидно,

$$a_1 = 4 \cdot 50 - 100 = 100, \quad a_2 = 4 \cdot 100 - 100 = 300,$$

а в общем случае

$$a_{n+1} = 4 \cdot a_n - 100, \quad n = 0, 1, 2, \dots$$

Полученное равенство является простейшим примером *рекуррентного соотношения*.

5.1.2. Перейдем теперь к формальным определениям.

Определение 5.2. Пусть $a_0, a_1, a_2, \dots$ — произвольная числовая последовательность. Если для любого $n \geq m$ число a_{n+m} является некоторой функцией от m предыдущих членов последовательности, т.е.

$$a_{n+m} = f(a_n, a_{n+1}, \dots, a_{n+m-1}), \quad (25)$$

то такая последовательность называется рекуррентной последовательностью, а соотношение (25) — рекуррентным соотношением m -го порядка.

В частном случае линейной функции f имеем так называемое *линейное рекуррентное соотношение*

$$a_{n+m} = b_1(n) a_{n+m-1} + b_2(n) a_{n+m-2} + \dots + b_{m-1}(n) a_{n+1} + b_m(n) a_n + u_n. \quad (26)$$

В случае $u_n = 0$ оно называется *однородным*, в противном случае — *неоднородным*.

Самый простой случай рекуррентного соотношения (26) — это *линейное однородное рекуррентное соотношение с постоянными коэффициентами*

$$a_{n+m} = b_1 a_{n+m-1} + b_2 a_{n+m-2} + \dots + b_{m-1} a_{n+1} + b_m a_n. \quad (27)$$

Очевидно, что для однозначного определения всех a_n необходимо наряду с самим рекуррентным соотношением (25) задать и первые m членов $a_0, a_1, \dots, a_{m-1}$ данной последовательности, то есть, как говорят, *задать начальные условия* для рекуррентного соотношения.

5.1.3. Итак, наличие рекуррентного соотношения и начальных условий позволяет нам последовательно, шаг за шагом, определить любое наперед заданное количество n членов рекуррентной числовой последовательности. Зачастую это все, что нам требуется от задачи. Иными словами, получение рекуррентного соотношения для искомой числовой последовательности a_n является вполне приемлемым, а зачастую — и наиболее удобным с вычислительной точки зрения ответом для поставленной комбинаторной задачи.

Однако иногда нам полезно иметь явную формулу, которая для любого n позволяет вычислять значение a_n . Такую формулу называют *решением* рассматриваемого рекуррентного соотношения. Мы в данном параграфе покажем, как строить такие решения для случая линейного однородного рекуррентного соотношения с постоянными коэффициентами (27).

5.2. Прежде чем рассматривать общий случай уравнения (27), рассмотрим наиболее простой его вариант — линейное однородное рекуррентное соотношение первого порядка

$$a_{n+1} = b_1 \cdot a_n, \quad n = 0, 1, 2, \dots; \quad a_0 — \text{заданное число}. \quad (28)$$

5.2.1. Решение этого уравнения построить легко. Действительно,

$$a_1 = b_1 \cdot a_0; \quad a_2 = b_1 \cdot a_1 = b_1^2 \cdot a_0; \quad \dots \quad a_n = b_1^n \cdot a_0.$$

5.2.2. Предположим теперь, что нам кто-то сразу подсказал вид решения, а именно, что решение нашего уравнения (28) степенным образом зависит от n :

$$a_n = r^n \quad \text{для некоторого } r.$$

Воспользовавшись этой подсказкой, подставим это выражение в исходное рекуррентное соотношение (28). В результате получается равенство вида

$$r^{n+1} = b_1 \cdot r^n,$$

из которого сразу же следует, что $r = b_1$; при этом a_n оказывается равным b_1^n . Это означает, что при $n = 0$ число $a_0 = b_1^0 = 1$. Иными словами, $a_n = b_1^n$ есть решение исходной задачи (28) в частном случае $a_0 = 1$. Поэтому такое решение называется *частным решением* уравнения (28).

5.2.3. Теперь попытаемся, зная частное решение, построить общее решение задачи (28). Для этого заметим, что в силу однородности уравнения (28) любое его частное решение, умноженное на произвольную постоянную c , по-прежнему этому уравнению удовлетворяет:

$$c \cdot b_1^{n+1} \equiv c \cdot b_1 \cdot b_1^n.$$

Решение же вида $c \cdot b_1^n$ позволяет удовлетворить любому начальному условию. Действительно, подставляя его в начальное условие для уравнения (28), получим:

$$c \cdot b_1^0 = a_0 \quad \implies \quad c = a_0 \quad \implies \quad a_n = a_0 \cdot b_1^n.$$

По этой причине решение вида $c \cdot b_1^n$ называется *общим решением* уравнения (28).

5.3. Подведем предварительные итоги. Так как исходное уравнение (28) было очень простым, то нам удалось сразу построить его решение и выяснить, что оно степенным образом зависит от параметра n . Затем мы заметили, что если бы нам кто-то заранее подсказал степенной характер решения уравнения (28), то нам хватило бы этой информации для построения как общего, так и частного решения нашего рекуррентного уравнения.

Возникает вопрос: зачем же нам нужен для столь простого уравнения столь сложный алгоритм построения его решения? Оказывается, что этот алгоритм практически без изменений работает и для построения решения линейного однородного уравнения произвольного порядка.

5.3.1. Рассмотрим в качестве примера линейное однородное рекуррентное соотношение второго порядка

$$a_{n+2} = b_1 \cdot a_{n+1} + b_2 \cdot a_n, \quad n = 0, 1, 2, \dots, \quad a_0, a_1 \text{ — заданные числа}, \quad (29)$$

и попытаемся применить к этому уравнению алгоритм, описанный в конце предыдущего пункта.

Для этого предположим, что частное решение уравнения (29) по-прежнему степенным образом зависит от параметра n , то есть предположим, что существуют такие значения параметров a_0 и a_1 , при которых $a_n = r^n$. Подставляя это выражение в рекуррентное соотношение, получим

$$r^{n+2} = b_1 \cdot r^{n+1} + b_2 \cdot r^n \quad \implies \quad r^2 - b_1 r - b_2 = 0, \quad (30)$$

т.е. квадратное уравнение на r . Любое его решение r_0 дает нам некоторое частное решение уравнения (29). По этой причине данное уравнение называется *характеристическим уравнением* для рекуррентного соотношения (29).

5.3.2. Предположим, что характеристическое уравнение (30) имеет два различных вещественных корня r_1 и r_2 . Покажем, что в таком случае выражение

$$a_n = c_1 r_1^n + c_2 r_2^n, \quad (31)$$

где c_1 и c_2 — произвольные постоянные, является *общим решением* соотношения (29) в том смысле, что любое решение (29) с заданными начальными условиями в нем содержится.

Действительно, покажем вначале, что выражение (31) действительно удовлетворяет рекуррентному соотношению (29):

$$c_1 r_1^{n+2} + c_2 r_2^{n+2} = b_1 c_1 r_1^{n+1} + b_1 c_2 r_2^{n+1} + b_2 c_1 r_1^n + b_2 c_2 r_2^n =$$

$$= c_1 (r_1^2 - b_1 r_1 - b_2) + c_2 (r_1^2 - b_1 r_1 - b_2) \equiv 0.$$

Покажем теперь, что это — действительно общее решение, т.е. что мы всегда можем подобрать константы c_1 и c_2 так, чтобы решение вида (31) удовлетворяло любым заданным начальным условиям. Для этого рассмотрим это выражение при $n = 0$ и $n = 1$:

$$\begin{aligned} a_0 &= c_1 r_1^0 + c_2 r_2^0 = c_1 + c_2, \\ a_1 &= c_1 r_1^1 + c_2 r_2^1 = c_1 r_1 + c_2 r_2. \end{aligned}$$

Эти выражения следует рассматривать как систему линейных уравнений для определения неизвестных постоянных c_1 и c_2 . Определитель этой системы

$$\begin{vmatrix} 1 & 1 \\ r_1 & r_2 \end{vmatrix} = r_2 - r_1 \neq 0,$$

поэтому система всегда имеет единственное решение.

5.3.3. Пожалуй, самым известным и важным примером рекуррентного соотношения (29) является соотношение вида

$$F_{n+2} = F_{n+1} + F_n, \quad n = 0, 1, 2, \dots, \quad F_0 = 0, \quad F_1 = 1,$$

определяющие так называемые числа Фибоначчи F_n . Характеристическое уравнение для этого рекуррентного уравнения имеет вид

$$r^2 = r + 1 \quad \Rightarrow \quad r_{1,2} = \frac{1 \pm \sqrt{5}}{2} \quad \Rightarrow \quad F_n = c_1 \left(\frac{1 + \sqrt{5}}{2} \right)^n + c_2 \left(\frac{1 - \sqrt{5}}{2} \right)^n.$$

Константы c_1 и c_2 определим из начальных условий:

$$\begin{aligned} F_0 = 0 &= c_1 + c_2 \\ F_1 = 1 &= c_1 \frac{1 + \sqrt{5}}{2} + c_2 \frac{1 - \sqrt{5}}{2} = c_1 \left[\frac{1 + \sqrt{5} - 1 + \sqrt{5}}{2} \right] = c_1 \sqrt{5} \quad \Rightarrow \\ &\Rightarrow \quad c_1 = +\frac{1}{\sqrt{5}}, \quad c_2 = -\frac{1}{\sqrt{5}}. \end{aligned}$$

Таким образом, окончательно получаем следующее явное выражение для чисел Фибоначчи:

$$F_n = \frac{1}{\sqrt{5}} \left(\frac{1 + \sqrt{5}}{2} \right)^n - \frac{1}{\sqrt{5}} \left(\frac{1 - \sqrt{5}}{2} \right)^n. \quad (32)$$

5.3.4. Предположим теперь, что характеристическое уравнение (30) имеет ровно один кратный корень $r_1 = r_2 =: \rho$. Покажем, что в этом случае общее решение уравнения (29) имеет вид

$$a_n = c_1 \rho^n + c_2 n \rho^n.$$

Мы уже показали, что частное решение вида ρ^n удовлетворяет уравнению (29). С учетом линейности и однородности этого уравнения нам осталось показать, что этому уравнению удовлетворяет и частное решение вида $n \rho^n$. Подставляя в уравнение (29) выражение $n \rho^n$, получим

$$(n + 2) \rho^{n+2} = b_1 (n + 1) \rho^{n+1} + b_2 n \rho^n \quad \Rightarrow \quad n (\rho^2 - b_1 \rho - b_2) + \rho (2 \rho - b_1) = 0.$$

Первое слагаемое в левой части этого выражения равно нулю в силу характеристического уравнения. Для того, чтобы понять, что равно нулю и последнее слагаемое, заметим, что в случае совпадающих корней $r_1 = r_2 = \rho$ имеем

$$\rho = \frac{b_1 \pm 0}{2} \implies 2\rho - b_1 = 0.$$

Осталось показать, что такой вид решения может удовлетворить любым начальным условиям. Подставив начальные условия в выражение для a_n , получим следующую систему двух линейных алгебраических уравнений относительно параметров c_1 и c_2 :

$$c_1 = a_0,$$

$$\rho(c_1 + c_2) = a_1.$$

Понятно, что такая система имеет решение при любых a_0, a_1 и $\rho \neq 0$. Случай же $\rho = 0$ тривиален — в этом случае $b_1 = b_2 = 0$, и потому $a_n = 0$ для любых n .

5.3.5. Наконец, давайте рассмотрим случай, когда уравнение (30) имеет два комплексно сопряжённых корня

$$r_1 = x + iy = \rho e^{i\vartheta}, \quad r_2 = x - iy = \rho e^{-i\vartheta}, \quad \rho, \vartheta \neq 0.$$

Покажем, что в таком случае общее решение линейного однородного рекуррентного соотношения с постоянными коэффициентами второго порядка (29) можно записать так:

$$a_n = \tilde{c}_1 \rho^n \cos(n\vartheta) + \tilde{c}_2 \rho^n \sin(n\vartheta).$$

Действительно, рассуждения, аналогичные проведенным для случая двух различных вещественных корней, показывают, что выражение вида

$$a_n = c_1 r_1^n + c_2 r_2^n$$

удовлетворяет рекуррентному соотношению (29) при любых c_1 и c_2 . Рассмотрим теперь систему линейных уравнений

$$\begin{aligned} a_0 &= c_1 + c_2, \\ a_1 &= c_1 \rho e^{i\vartheta} + c_2 \rho e^{-i\vartheta} = \rho(c_1 + c_2) \cos \vartheta + \rho i(c_1 - c_2) \sin \vartheta. \end{aligned} \tag{33}$$

Определитель этой системы

$$\begin{vmatrix} 1 & 1 \\ \rho e^{i\vartheta} & \rho e^{-i\vartheta} \end{vmatrix} = \rho(e^{-i\vartheta} - e^{i\vartheta}) = -\rho \cdot 2i \cdot \sin(\vartheta) \neq 0,$$

поэтому мы с помощью общего решения действительно сможем удовлетворить любым начальным условиям.

Перепишем теперь выражение для a_n :

$$\begin{aligned} a_n &= c_1 r_1^n + c_2 r_2^n = c_1 \rho^n e^{i\vartheta n} + c_2 \rho^n e^{-i\vartheta n} = \\ &= (c_1 + c_2) \rho^n \cos(n\vartheta) + i(c_1 - c_2) \rho^n \sin(n\vartheta). \end{aligned}$$

Из (33) следует, что коэффициенты $\tilde{c}_1 = c_1 + c_2$ и $\tilde{c}_2 = i(c_1 - c_2)$ являются вещественными числами. Следовательно, общее решение в данном случае действительно можно записать в виде

$$a_n = \tilde{c}_1 \rho^n \cos(n\vartheta) + \tilde{c}_2 \rho^n \sin(n\vartheta).$$

5.3.6. Описанная выше техника решения линейных однородных рекуррентных соотношений с постоянными коэффициентами достаточно легко обобщается и на случай соотношений более высокого порядка. Именно, рассмотрим линейное однородное рекуррентное соотношение m -го порядка (27)

$$a_{n+m} = b_1 \cdot a_{n+m-1} + b_2 \cdot a_{n+m-2} + \dots + b_m \cdot a_n, \quad a_0, \dots, a_{m-1} \text{ — заданы.}$$

Предположим, что частное решение этого соотношения имеет вид $a_n = r^n$. Подставляя это выражение в исходное рекуррентное соотношение, получаем для параметра r следующее характеристическое уравнение:

$$r^m = b_1 \cdot r^{m-1} + b_2 \cdot r^{m-2} + \dots + b_m \cdot r.$$

Пусть $r_1, \dots, r_k$ есть корни этого уравнения. Каждый такой корень дает свой вклад в общее решение рассматриваемого рекуррентного соотношения. В частности, если r_j есть корень кратности q_j , то вклад этого корня в общее решение задается выражением вида

$$c_{1,j} \cdot r_j^n + c_{2,j} \cdot n \cdot r_j^n + \dots + c_{q_j,j} \cdot n^{q_j-1} \cdot r_j^n.$$

Так, если характеристическое уравнение для некоторого рекуррентного соотношения шестого порядка имеет вид

$$(r-1)^3 \cdot (r-2)^2 \cdot (r-3) = 0,$$

то общее решение такого соотношения записывается так:

$$a_n = c_1 + c_2 \cdot n + c_3 \cdot n^2 + c_4 \cdot 2^n + c_5 \cdot n \cdot 2^n + c_6 \cdot 3^n.$$

5.4. Читатели, хорошо знакомые с математическим анализом, уже, видимо, заметили, насколько похожи методы решения линейных рекуррентных соотношений и методы решения линейных обыкновенных дифференциальных уравнений с постоянными коэффициентами.

5.4.1. Действительно, рассмотрим линейное однородное дифференциальное уравнение первого порядка вида

$$\frac{dy}{dx} = b_1 \cdot y(x), \quad y(x_0) = y_0.$$

Такое уравнение легко решается с помощью разделения переменных:

$$\begin{aligned} \frac{dy}{y} = b_1 \cdot dx &\iff d \ln(y) = b_1 \cdot dx &\iff \int_{y_0}^y d \ln(y) = b_1 \cdot \int_{x_0}^x dx &\iff \\ &\iff \ln(y) - \ln(y_0) = \ln \frac{y}{y_0} = b_1 \cdot (x - x_0) &\iff y = y_0 e^{b_1 \cdot (x - x_0)}. \end{aligned}$$

Как и в случае рекуррентных соотношений, мы могли бы решить это уравнение и без использования метода разделения переменных — для его решения достаточно знать характер решения такого дифференциального уравнения. Именно, предположим, что решение $y(x)$ экспоненциально зависит от x :

$$y(x) = e^{\lambda \cdot x}.$$

Подставим это выражение в исходное дифференциальное уравнение:

$$y'(x) = \lambda \cdot e^{\lambda \cdot x} = b_1 \cdot e^{\lambda \cdot x} \iff \lambda = b_1.$$

Заметим теперь, что решение $y(x) = e^{b_1 \cdot x}$ удовлетворяет начальным условиям $y(x_0) = e^{b_1 \cdot x_0}$. Для того, чтобы удовлетворить произвольным начальным условиям, достаточно воспользоваться однородностью данного уравнения и рассмотреть вместо частного общее решение вида $y(x) = c \cdot e^{b_1 \cdot x}$. Константа c легко находится из начальных условий:

$$y(x_0) = y_0 = c \cdot e^{b_1 \cdot x_0} \implies c = y_0 \cdot e^{-b_1 \cdot x_0} \implies y = y_0 \cdot e^{b_1(x-x_0)}.$$

5.4.2. Теперь рассмотрим линейное однородное дифференциальное уравнение второго порядка с постоянными коэффициентами

$$y''(x) = b_1 \cdot y'(x) + b_2 \cdot y(x), \quad y(0) = x_0, \quad y'(0) = x_1.$$

Предполагая, что характер решения этого уравнения остался тем же, что и в предыдущем случае, а именно, полагая, что $y(x) = e^{\lambda \cdot x}$, мы в результате подстановки этого выражения в исходное дифференциальное уравнение получаем абсолютно то же самое характеристическое уравнение на параметр λ , что и в случае линейного однородного рекуррентного соотношения второго порядка с постоянными коэффициентами:

$$y''(x) = \lambda^2 \cdot e^{\lambda \cdot x} = b_1 \cdot \lambda \cdot e^{\lambda \cdot x} + b_2 \cdot e^{\lambda \cdot x} \implies \lambda^2 - b_1 \cdot \lambda - b_2 = 0.$$

Если теперь это уравнение имеет пару различных вещественных корней λ_1 и λ_2 , то общее решение обыкновенного дифференциального уравнения в силу его линейности и однородности записывается в виде

$$y(x) = c_1 \cdot e^{\lambda_1 \cdot x} + c_2 \cdot e^{\lambda_2 \cdot x}.$$

В случае единственного вещественного корня λ характеристического уравнения решение по-прежнему ищется в виде

$$y(x) = c_1 \cdot e^{\lambda \cdot x} + c_2 \cdot x \cdot e^{\lambda \cdot x}.$$

Наконец, в случае комплексных корней $\lambda_{1,2} = \alpha \pm i \cdot \beta$ решение обыкновенного дифференциального уравнения можно искать в виде

$$y(x) = c_1 \cdot e^{\alpha \cdot x} \cos(\beta \cdot x) + c_2 \cdot e^{\alpha \cdot x} \sin(\beta \cdot x).$$

5.4.3. Отмеченная аналогия наводит нас на мысль о существовании взаимно-однозначного отображения, позволяющего сопоставить линейному однородному рекуррентному соотношению с постоянными коэффициентами аналогичное линейное однородное дифференциальное уравнение с постоянными коэффициентами. Оказывается, что такое отображение построить достаточно просто. Рассмотрим для определенности линейное однородное рекуррентное соотношение с постоянными коэффициентами второго порядка:

$$a_{n+2} = b_1 \cdot a_{n+1} + b_2 \cdot a_n, \quad a_0, a_1 — \text{заданные числа}.$$

Домножим это уравнение на $x^n/n!$ и просуммируем по n от 0 до $+\infty$:

$$\sum_{n=0}^{\infty} a_{n+2} \frac{x^n}{n!} = b_1 \sum_{n=0}^{\infty} a_{n+1} \frac{x^n}{n!} + b_2 \sum_{n=0}^{\infty} a_n \frac{x^n}{n!}.$$

Предположим теперь, что ряд

$$a_0 + a_1 \frac{x^1}{1!} + a_2 \frac{x^2}{2!} + \dots + a_n \frac{x^n}{n!} + \dots = \sum_{n=0}^{\infty} a_n \frac{x^n}{n!}$$

представляет собой ряд Тейлора некоторой функции $y(x)$, построенный в окрестности точки $x = 0$:

$$y(x) = \sum_{n=0}^n a_n \frac{x^n}{n!}, \quad a_n = y^{(n)}(0).$$

Тогда

$$y'(x) = a_1 + a_2 \frac{x^1}{1!} + a_3 \frac{x^2}{2!} + \dots + a_n \frac{x^{n-1}}{(n-1)!} + a_{n+1} \frac{x^n}{n!} + \dots = \sum_{n=0}^n a_{n+1} \frac{x^n}{n!},$$

$$y''(x) = a_2 + a_3 \frac{x^1}{1!} + a_4 \frac{x^2}{2!} + \dots + a_n \frac{x^{n-2}}{(n-2)!} + a_{n+1} \frac{x^{n-1}}{(n-1)!} + a_{n+2} \frac{x^n}{n!} + \dots = \sum_{n=0}^n a_{n+2} \frac{x^n}{n!},$$

так что исходное рекуррентное соотношение превращается в обыкновенное дифференциальное уравнение вида

$$y''(x) = b_1 \cdot y'(x) + b_2 \cdot y(x)$$

с начальными условиями $y(0) = a_0$, $y'(0) = a_1$. Обратно, раскладывая функцию $y(x)$ в ряд Тейлора в окрестности точки $x = 0$, подставляя это разложение в обыкновенное дифференциальное уравнение и приравнявая коэффициенты при одинаковых степенях $x^n/n!$, мы из исходного обыкновенного дифференциального уравнения получаем рекуррентное соотношение на коэффициенты $a_n = y^{(n)}(0)$.

5.4.4. Полученное нами взаимно-однозначное преобразование полезно как для решения обыкновенных дифференциальных уравнений, так и для решения рекуррентных соотношений. Так, с вычислительной точки зрения иногда имеет смысл переходить от обыкновенного дифференциального уравнения к соответствующему рекуррентному соотношению. Быстрое вычисление чисел a_n позволяет эффективно вычислять коэффициенты в разложении искомой функции в ряд Тейлора, а следовательно, и значение этой функции в произвольной точке x .

Напротив, методы, разработанные для решения обыкновенных дифференциальных уравнений, часто оказываются полезными и для решения аналогичных рекуррентных соотношений. В качестве примера рассмотрим неоднородные линейные дифференциальные уравнения m -го порядка. Общее решение таких уравнений есть общее решение соответствующего однородного уравнения плюс частное решение неоднородного. Для нахождения частного решения неоднородного уравнения часто можно использовать так называемый метод неопределенных коэффициентов. На языке рекуррентных соотношений его можно сформулировать следующим образом.

Рассмотрим неоднородное линейное рекуррентное соотношение

$$a_{n+m} = b_1 \cdot a_{n+m-1} + b_2 \cdot a_{n+m-2} + \dots + b_m \cdot a_n + u_n, \quad a_0, \dots, a_{m-1} \text{ — заданы.}$$

Ранее мы отмечали, что общее решение соответствующего однородного рекуррентного соотношения представляет собой сумму функций $f_j(n)$ вида

$$f_j(n) = (c_{1,j} + c_{2,j} \cdot n + c_{3,j} \cdot n^2 + \dots + c_{q_j,j} \cdot n^{q_j-1}) \cdot r_j^n.$$

Предположим, что неоднородность $u_n \equiv u(n)$ имеет вид

$$u(n) = (d_0 + d_1 \cdot n + \dots + d_l \cdot n^l) \cdot r^s =: P_l(n) \cdot r^s.$$

Тогда частное решение исходного неоднородного уравнения следует искать в виде

$$(c_0 + c_1 \cdot n + \dots + c_l \cdot n^l) \cdot n^q \cdot r^s,$$

где $q = 0$ в случае, если r отличен от корней r_j характеристического уравнения, и равно кратности корня r_j в случае, если r совпадает с одним из корней r_j . В случае, когда неоднородность представляет собой сумму описанных выше функций u_t , частное решение рекуррентного соотношения можно искать в виде суммы частных решений неоднородных рекуррентных соотношений вида

$$a_{n+m} = b_1 \cdot a_{n+m-1} + b_2 \cdot a_{n+m-2} + \dots + b_m \cdot a_n + u_j(n).$$

5.4.5. Разберем несколько примеров решения неоднородных рекуррентных соотношений.

Пример 5.3. Построить общее решение неоднородного рекуррентного соотношения второго порядка

$$a_{n+2} = 4a_{n+1} - 4a_n + 3 \cdot 2^n.$$

Решение. Характеристическое уравнение для соответствующего однородного рекуррентного соотношения имеет следующий вид:

$$r^2 - 4r + 4 = 0 \quad \Longleftrightarrow \quad (r - 2)^2 = 0.$$

Так как $r = 2$ есть корень кратности 2, то частное решение исходного неоднородного рекуррентного соотношения следует искать в виде

$$c \cdot n^2 \cdot 2^n.$$

Подставим это выражение в рекуррентное соотношение:

$$\begin{aligned} c \cdot (n+2)^2 \cdot 2^{n+2} &= 4c \cdot (n+1)^2 \cdot 2^{n+1} - 4c \cdot n^2 \cdot 2^n + 3 \cdot 2^n && \Longleftrightarrow \\ \Longleftrightarrow \quad 4c(n^2 + 4n + 4) &= 8c(n^2 + 2n + 1) - 4cn^2 + 3 && \Longleftrightarrow \quad 8c = 3. \end{aligned}$$

Следовательно, $c = 3/8$, так что частное решение заданного рекуррентного соотношения имеет вид

$$3 \cdot n^2 \cdot 2^{n-3}.$$

Пример 5.4. Построить общее решение следующего линейного неоднородного рекуррентного соотношения второго порядка:

$$a_{n+2} = 6a_{n+1} - 9a_n + 3^n \cdot n + 3^n \cdot \cos(\pi n/2).$$

Решение. Для построения общего решения соответствующего однородного рекуррентного соотношения запишем его характеристическое уравнение:

$$r^2 = 6r - 9 \quad \Longleftrightarrow \quad (r - 3)^2 = 0.$$

Как видно, это уравнение имеет корень $r = 3$ кратности два. Следовательно, общее решение однородного рекуррентного соотношения записывается в виде

$$(d_1 + d_2 \cdot n) \cdot 3^n.$$

Неоднородная часть рекуррентного соотношения состоит из двух слагаемых:

$$u_1(n) = 3^n \cdot n \quad \text{и} \quad u_2(n) = 3^n \cdot \cos(\pi n/2).$$

Так как

$$\cos(2n) = \frac{e^{i\pi n/2} + e^{-i\pi n/2}}{2},$$

то выражение для $u_2(n)$ можно переписать так:

$$u_2(n) = \frac{1}{2} (r_1^n + r_2^n), \quad \text{где} \quad r_1 = 3 \cdot e^{i\pi/2}, \quad r_2 = 3 \cdot e^{-i\pi/2}.$$

Иными словами, неоднородная часть рекуррентного соотношения состоит из трех слагаемых вида $r^n \cdot P_i(n)$, и только в первом из них показатель совпадает с корнем характеристического уравнения. Как следствие, мы можем искать отдельно частное решение, связанное с первым слагаемым, и частное решение, связанное с оставшимися слагаемыми.

Рассмотрим вначале рекуррентное соотношение

$$a_{n+2} = 6a_{n+1} - 9a_n + 3^n \cdot n.$$

Частное его решение следует искать в виде $(c_1 + c_2 \cdot n) \cdot n^2 \cdot 3^n$. Подставляя это выражение в рекуррентное соотношение, получим равенство

$$54n \cdot c_2 + 54 \cdot c_2 + 18 \cdot c_1 = n.$$

Приравнявая коэффициенты при одинаковых степенях n , получаем значения констант $c_2 = 1/54$, $c_1 = -1/18$.

Теперь запишем рекуррентное соотношение

$$a_{n+2} = 6a_{n+1} - 9a_n + 3^n \cdot \cos(\pi n/2) \iff a_{n+2} = 6a_{n+1} - 9a_n + 3^n \cdot e^{i\pi n/2}/2 + 3^n \cdot e^{-i\pi n/2}/2.$$

Частное его решение можно искать в виде умноженной на 3^n линейной комбинации экспонент с показателями $\pm i\pi n/2$, либо, что более удобно, в виде линейной комбинации синуса и косинуса, умноженной на 3^n :

$$c_3 \cdot 3^n \cdot \cos(\pi n/2) + c_4 \cdot 3^n \cdot \sin(\pi n/2).$$

Подставляя это выражение в записанное выше рекуррентное соотношение, получаем равенство

$$18 \cdot c_3 \cdot \sin(\pi n/2) - (18 \cdot c_4 + 1) \cdot \cos(\pi n/2) = 0,$$

из которого следует, что $c_3 = 0$, $c_4 = -1/18$.

Окончательно получаем следующее общее решение исходного рекуррентного соотношения:

$$(d_1 + d_2 \cdot n) \cdot 3^n + (n - 3) \cdot n^2 \cdot 3^{n-3}/2 - 3^{n-2} \cdot \sin(\pi n/2)/2.$$

6 Производящие функции и формальные степенные ряды

6.1. Понятие производящей функции является, пожалуй, самым важным понятием современной перечислительной комбинаторики. Основная задача данного параграфа состоит в том, чтобы объяснить комбинаторный смысл производящей функции, а также дать по возможности строгое ее определение.

6.1.1. Пусть вначале X есть некоторое *конечное* множество. Первое, что обычно нам хочется сделать — это указать мощность этого множества, то есть подсчитать количество всех элементов в нем. Однако, как правило, нам этой информации оказывается недостаточно — на следующем этапе мы обычно хотим как-то классифицировать элементы этого множества X , то есть разбить множество на блоки, объединенные по тому или иному признаку.

Пример 6.1. Рассмотрим множество всех товаров на складе. Конечно, может быть кому-то и полезно знать общее количество N единиц хранимых на складе товаров. Однако любой кладовщик вам скажет, что значительно полезнее иметь информацию о количестве единиц товара каждой категории в отдельности — например, о количестве бутылок вина, коробок с мылом, пакетов с чаем. При таком подходе мы, конечно же, знаем и общее число N товаров — для его получения нам достаточно сложить количества товаров каждой категории.

Пример 6.2. Как мы уже знаем, общее количество подмножеств n -элементного множества X равно 2^n . Однако, как правило, нас интересует более подробная информация об этих подмножествах, например, сколько существует подмножеств, содержащих ровно k элементов. Число таких подмножеств равно, по определению, биномиальному коэффициенту $\binom{n}{k}$, а суммирование этих коэффициентов по всем $k = 0, \dots, n$ дает нам 2^n .

6.1.2. Рассмотрим теперь *счетное* множество X , например, множество всех графов. Здесь вообще ставить вопрос о количестве всех объектов данного множества бессмысленно. Однако и в этом случае задачу перечисления можно сделать вполне содержательной, и сделать это можно с помощью того же подхода. Именно, можно разбить множество X на конечные блоки по тому или иному признаку, и перечислять количество элементов в каждом конкретном блоке.

Например, бессмысленно перечислять все звезды во Вселенной. Однако перечислить все звезды в данной галактике — вполне разумная задача. Далее, столь же бессмысленно перечислять все графы. Однако перечисление всех различных графов на n вершинах при заданном n есть также вполне содержательная и важная с практической точки зрения задача.

6.1.3. Заметим также, что именно этот принцип, а именно, принцип разбиения множества перечисляемых нами элементов на блоки с дальнейшим подсчетом элементов в каждом отдельном блоке, мы, по сути, использовали для получения всех основных формул элементарной комбинаторики. Если при этом количество перечисляемых объектов в данном множестве выражалось через количество тех же самых объектов, но в меньших множествах, то мы на выходе получали некоторое рекуррентное соотношение, позволяющее определить количество перечисляемых объектов.

6.1.4. Оказывается, существует очень полезный способ разбиения множества на блоки, который, собственно, и приводит к понятию производящей функции. Именно, припишем всем элементам x рассматриваемого множества X некоторый вес $w(x)$ так, чтобы этот вес совпадал на всех элементах одного и того же блока. Формально сделать это можно с помощью отображения

$$w : X \longrightarrow K$$

множества X в некоторое коммутативное кольцо K , сопоставляющего всем элементам x данного блока B_k одно и то же значение $w(x) = k$, $k \in K$:

$$B_k = \{x \mid w(x) = k\}, \quad X = \bigcup_{k \in K} B_k = \bigcup_{k \in K} \{x \mid w(x) = k\}.$$

Заметим, что при таком подходе всему множеству X в кольце K отвечает вполне конкретный элемент

$$\sum_{x \in X} w(x) = \sum_{k \in K} c_k \cdot k, \quad c_k = |w^{-1}(k)| = |B_k|,$$

называемый *эnumerатором* множества X .

Пример 6.3. Пусть на складе имеются три пакета с чаем, две бутылки вина и четыре коробки с мылом:

$$X = \{\text{чай}_1, \text{чай}_2, \text{чай}_3, \text{вино}_1, \text{вино}_2, \text{мыло}_1, \text{мыло}_2, \text{мыло}_3, \text{мыло}_4\}.$$

Рассмотрим теперь отображение w этого множества X в коммутативное кольцо K (то есть кольцо, в котором операция умножения коммутативна и ассоциативна; как правило, считают, что это кольцо с единицей, то есть в нем существует нейтральный элемент относительно операции умножения) над множеством, содержащим элементы $\{\text{ч}, \text{в}, \text{м}\}$, задаваемое равенствами

$$w(\text{чай}_i) = \text{ч}, \quad w(\text{вино}_i) = \text{в}, \quad w(\text{мыло}_i) = \text{м}.$$

Тогда все множество X разобьется на три блока, а эnumerатор этого множества примет вид

$$w(X) = 3\text{ч} + 2\text{в} + 4\text{м}.$$

Пример 6.4. Рассмотрим множество 2^X всех подмножеств n -элементного множества X , а также коммутативное кольцо K над множеством, содержащим элементы x и y . Сопоставим любому элементу $Y \subset X$ множества 2^X вес $w = x^k y^{n-k}$, где k есть мощность подмножества Y . Отображение $w : 2^X \rightarrow K$ разобьет множество 2^X на блоки B_k мощности $c_k = \binom{n}{k}$. При этом самому множеству 2^X в кольце K будет соответствовать эnumerатор вида

$$w(2^X) = \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} x^k y^{n-k} = (x + y)^n. \quad (34)$$

6.1.5. Как правило, в перечислительной комбинаторике при построении отображения $w : X \rightarrow K$ используют несколько стандартных колец. Именно, рассмотрим множество $\mathbb{C}^{\mathbb{Z}^+}$ всех счетных последовательностей $(a_0, a_1, a_2, \dots)$ комплексных чисел:

$$\mathbb{C}^{\mathbb{Z}^+} := \{(a_0, a_1, a_2, \dots) \mid a_i \in \mathbb{C} \quad \forall i \in \mathbb{Z}_+\}.$$

Введем на этом множестве две базовые операции — сложения и умножения. Операция сложения числовых последовательностей определяется обычно как операция поэлементного сложения:

$$(a_0, a_1, a_2, \dots) + (b_0, b_1, b_2, \dots) = (a_0 + b_0, a_1 + b_1, a_2 + b_2, \dots). \quad (35)$$

Операцию же умножения

$$(a_0, a_1, a_2, \dots) \cdot (b_0, b_1, b_2, \dots) = (c_0, c_1, c_2, \dots)$$

можно вводить по-разному. Чаще всего на практике используются следующие два способа умножения этих последовательностей: свертка

$$c_n = \sum_{i=0}^n a_i \cdot b_{n-i} \quad (36)$$

и биномиальная свертка

$$c_n = \sum_{i=0}^n \binom{n}{i} \cdot a_i \cdot b_{n-i} \quad (37)$$

числовых последовательностей. В обоих случаях множество $\mathbb{C}^{\mathbb{Z}^+}$ с введенными на нем операциями представляет собой коммутативное кольцо (точнее, коммутативную область целостности, то есть кольцо, в котором произведение ненулевых элементов кольца отлично от нуля).

6.1.6. На практике с такими кольцами удобно работать как с кольцами $\mathbb{C}[[z]]$ и $\mathbb{C}_e[[z]]$ формальных степенных рядов. В таких кольцах для элемента $(0, 1, 0, 0, \dots)$ вводится специальное обозначение

$$(0, 1, 0, 0, \dots) =: z.$$

Рассмотрим вначале случай кольца $\mathbb{C}[[z]]$ с правилом умножения (36). Заметим, что

$$z^2 := z \cdot z = (0, 1, 0, 0, \dots) \cdot (0, 1, 0, 0, \dots) = (0 \cdot 0, 0 \cdot 1 + 1 \cdot 0, 0 \cdot 0 + 1 \cdot 1 + 0 \cdot 0, \dots) = (0, 0, 1, 0, \dots),$$

$$\begin{aligned} z^3 &:= z \cdot z \cdot z = (0, 1, 0, 0, \dots) \cdot (0, 1, 0, 0, \dots) \cdot (0, 1, 0, 0, \dots) = (0, 1, 0, 0, \dots) \cdot (0, 0, 1, 0, \dots) = \\ &= (0 \cdot 0, 0 \cdot 0 + 1 \cdot 0, 0 \cdot 1 + 1 \cdot 0 + 0 \cdot 0, 0 \cdot 0 + 1 \cdot 1 + 0 \cdot 0 + 0 \cdot 0, \dots) = (0, 0, 0, 1, 0, \dots), \end{aligned}$$

В общем случае, как несложно проверить по индукции,

$$z^n := \underbrace{z \cdot z \cdot \dots \cdot z}_n = (0, \dots, 0, 1, 0, \dots),$$

где единица в последнем выражении стоит на n -й позиции, $n = 0, 1, \dots$. Как следствие, любую последовательность чисел $(a_0, a_1, a_2, \dots)$ можно записать в виде формального степенного ряда

$$(a_0, a_1, a_2, \dots) = \sum_{n=0}^{+\infty} a_n z^n =: a(z) \in \mathbb{C}[[z]].$$

Аналогично, в случае кольца $\mathbb{C}_e[[z]]$ с правилом умножения (37) несложно убедиться в том, что

$$z^n := \underbrace{z \cdot z \cdot \dots \cdot z}_n = (0, \dots, 0, n!, 0, \dots),$$

причем единственное ненулевое число $n!$ стоит в этой последовательности на n -м месте. Поэтому в кольце $\mathbb{C}_e[[z]]$ любая последовательность чисел $(a_0, a_1, a_2, \dots)$ может быть записана так:

$$(a_0, a_1, a_2, \dots) = \sum_{n=0}^{+\infty} a_n \frac{z^n}{n!} =: A(z) \in \mathbb{C}_e[[z]].$$

6.1.7. Вернемся теперь к перечисляемому нами множеству X и рассмотрим отображение

$$w : X \longrightarrow \mathbb{C}[[z]],$$

которое любому элементу $x \in X$ сопоставляет некоторый формальный степенной ряд вида

$$w(x) = 0 \cdot 1 + 0 \cdot z + \dots + 0 \cdot z^{k-1} + 1 \cdot z^k + 0 \cdot z^{k+1} + \dots = z^k.$$

По сути дела, при таком подходе вес любого элемента $x \in X$ определяется степенью $k \in \mathbb{Z}_+$ особого элемента z кольца $\mathbb{C}[[z]]$. Тогда суммирование образов $w(x)$ этого отображения по всем $x \in X$ даст нам энумератор вида

$$f(z) := \sum_{x \in X} w(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} c_n z^n,$$

то есть формальный степенной ряд, коэффициенты c_n которого дают нам количество элементов $x \in X$, имеющих заданный вес $z^n = (0, 0, \dots, 0, 1, 0, \dots)$. Этот энумератор и называют *обыкновенной производящей функцией* множества X .

Аналогично, рассматривая отображение

$$w_e : X \longrightarrow \mathbb{C}_e[[z]],$$

сопоставляющее любому элементу $x \in X$ формальный степенной ряд вида

$$w(x) = 0 \cdot 1 + 0 \cdot \frac{z}{1!} + \dots + 0 \cdot \frac{z^{k-1}}{(k-1)!} + 1 \cdot \frac{z^k}{k!} + 0 \cdot \frac{z^{k+1}}{(k+1)!} + \dots = \frac{z^k}{k!},$$

мы получаем в качестве энумератора X формальный степенной ряд

$$F(z) := \sum_{x \in X} w_e(x) = \sum_{n=0}^{+\infty} c_n \frac{z^n}{n!},$$

называемый *экспоненциальной производящей функцией* множества X .

6.1.8. Согласно определению, каждая производящая функция является элементом кольца формальных степенных рядов. Следовательно, любую пару производящих функций можно складывать и перемножать между собой.

Формальные правила сложения и умножения этих функций, естественно, совпадают с описанными выше правилами (35)–(37) сложения и умножения отвечающих этим рядам числовых последовательностей. Именно, пусть

$$f(z) = a_0 + a_1 z + a_2 z^2 + \dots \quad \text{и} \quad g(z) = b_0 + b_1 z + b_2 z^2 + \dots$$

есть пара обыкновенных производящих функций для множеств X и Y соответственно, а

$$F(z) = a_0 + a_1 \frac{z}{1!} + a_2 \frac{z^2}{2!} + \dots \quad \text{и} \quad G(z) = b_0 + b_1 \frac{z}{1!} + b_2 \frac{z^2}{2!} + \dots$$

есть пара экспоненциальных производящих функций для этой пары множеств. Тогда суммой этих производящих функций называются формальные степенные ряды

$$f(z) + g(z) := (a_0 + b_0) + (a_1 + b_1)z + (a_2 + b_2)z^2 + \dots$$

и

$$F(z) + G(z) := (a_0 + b_0) + (a_1 + b_1) \frac{z}{1!} + (a_2 + b_2) \frac{z^2}{2!} + \dots$$

Произведением производящих функций называются формальные степенные ряды

$$h(z) = f(z) \cdot g(z) := c_0 + c_1 z + c_2 z^2 + \dots \quad \text{и} \quad H(z) = F(z) \cdot G(z) := c_0 + c_1 \frac{z}{1!} + c_2 \frac{z^2}{2!} + \dots,$$

коэффициенты c_n которых вычисляются по формулам (36) и (37) соответственно.

Важно, что сложение и умножение любых двух производящих функций имеет и вполне определенный комбинаторный смысл. Выяснение этого смысла мы отложим до одного из следующих параграфов. Сейчас же, на время забыв о перечисляемом множестве X , займемся изучением свойств производящих функций с точки зрения теории формальных степенных рядов.

6.2. Итак, по определению, обыкновенная и экспоненциальная производящие функции являются элементами формальных степенных рядов $\mathbb{C}[[z]]$ и $\mathbb{C}_e[[z]]$. Поговорим немного подробнее о таких формальных степенных рядах.

6.2.1. Прежде всего, подчеркнем отличие формальных степенных рядов от рядов, встречающихся в математическом анализе. По сути дела, любой формальный степенной ряд — это некоторая картинка, удобная для изображения заданной числовой последовательности $(a_0, a_1, a_2, \dots)$. Например, рассмотрим формальный степенной ряд

$$f(z) = \sum_{n=0}^{+\infty} n! z^n = 1 + z + 2z^2 + 6z^3 + 24z^4 + \dots, \quad (38)$$

отвечающий числовой последовательности $(1, 1, 2, 6, 24, \dots)$. Символы $1, z, z^2, z^3, \dots$ в такой форме записи играют, по сути, роль индексов — они нужны лишь для того, чтобы указывать позиции, на которых стоят элементы этой числовой последовательности. Например, если коэффициент при z^4 равен 24, то это означает лишь, что число 24 есть четвертый элемент рассматриваемой числовой последовательности.

Как следствие, в теории формальных степенных рядов символ z не надо рассматривать как комплексную переменную, которая может принимать какие-то конкретные значения. Нет смысла вычислять значения таких рядов как предел последовательности частичных сумм ни при каких конкретных значениях z . Наконец, в этой теории можно обойтись без понятия сходящихся или расходящихся рядов.

Так, например, с точки зрения математического анализа рассматривать ряд (38) смысла не имеет — он расходится при всех значениях $z > 0$. В комбинаторике же этот ряд, понимаемый как обыкновенная производящая функция, имеет вполне конкретный и весьма важный комбинаторный смысл: коэффициенты этого ряда задают количество всех перестановок заданного n -элементного множества.

6.2.2. Несмотря на все вышесказанное, опыт, накопленный при работе с рядами из математического анализа, часто бывает полезен и при анализе формальных степенных рядов. Связано это, прежде всего, с тем, что многие базовые операции над рядами, такие, как сложение или умножение, вводятся одинаково как для обычных, так и для формальных степенных рядов.

Пример 6.5. Перемножим два формальных степенных ряда из $\mathbb{C}[[z]]$:

$$f(z) = \sum_{n=0}^{+\infty} \alpha^n z^n \quad \text{и} \quad g(z) = 1 - \alpha z.$$

Коэффициент c_0 в произведении $h(z) = f(z) \cdot g(z)$, очевидно, равен $\alpha^0 \cdot 1 = 1$. Несложно убедиться, что остальные коэффициенты c_k равны нулю:

$$c_k = \alpha^k \cdot 1 - \alpha \cdot \alpha^{k-1} \equiv 0.$$

Следовательно,

$$f(z) \cdot g(z) = \left(\sum_{n=0}^{+\infty} \alpha^n z^n \right) \cdot (1 - \alpha z) = 1 \quad \implies \quad f(z) = \sum_{n=0}^{+\infty} \alpha^n z^n = g^{-1}(z) = (1 - \alpha z)^{-1} =: \frac{1}{1 - \alpha z}.$$

Заметим теперь, что формула

$$1 + \alpha z + \alpha^2 z^2 + \dots = \frac{1}{1 - \alpha z} \quad \forall \alpha \in \mathbb{C} \quad (39)$$

есть хорошо известная формула для суммы геометрической прогрессии. В математическом анализе смысл этой формулы состоит в следующем: ряд, стоящий в левой ее части, сходится к функции, стоящей в ее правой части, при всех z , таких, что $|\alpha z| < 1$. В теории формальных степенных рядов ее смысл другой: формула означает, что функции $f(z)$ и $g(z)$ являются взаимно-обратными по отношению к операции умножения в кольце $\mathbb{C}[[z]]$ формальных степенных рядов. Однако, несмотря на смысловые отличия, вид самого тождества и в том, и в другом случае одинаков.

6.2.3. Сформулированное выше наблюдение можно использовать для получения различных соотношений, связывающих элементы кольца формальных степенных рядов. Именно, пусть у нас имеются две функции $f(z)$ и $g(z)$ комплексного аргумента, аналитические в некоторой общей для них окрестности точки $z = 0$. Предположим, что в этой окрестности функции удовлетворяют какому-то общему для них соотношению. Представим эти функции в форме сходящихся степенных рядов. Тогда высока вероятность того, что указанное выше соотношение будет справедливым и как некоторое соотношение между формальными степенными рядами, то есть как некоторое соотношение, справедливое для некоторых двух элементов кольца формальных степенных рядов.

С этой точки зрения доказанное в примере 6.5 тождество (39) может быть получено так. Рассмотрим функции комплексного аргумента

$$f(z) = \frac{1}{1 - \alpha z} \quad \text{и} \quad g(z) = 1 - \alpha z,$$

аналитические в области $|\alpha z| < 1$. Последнее, в частности, означает, что эти функции в области $|\alpha z| < 1$ единственным образом представляются своими рядами Тейлора

$$f(z) = 1 + \alpha z + \alpha^2 z^2 + \dots \quad \text{и} \quad g(z) = 1 - \alpha z + 0z^2 + \dots$$

Кроме того, в этой области для них справедливо очевидное равенство $f(z) \cdot g(z) = 1$, которое в терминах соответствующих им рядов записывается так:

$$f(z) \cdot g(z) = 1 \quad \iff \quad \left(\sum_{n=0}^{+\infty} \alpha^n z^n \right) \cdot (1 - \alpha z) = 1. \quad (40)$$

Все, что теперь остается проверить — это то, что данное равенство останется справедливым, если его рассматривать и как некоторое тождество между формальными степенными рядами в $\mathbb{C}[[z]]$.

Рассмотрим еще несколько примеров из этой же серии.

Пример 6.6. Рассмотрим функции $F(z) = \exp(z)$ и $G(z) = \exp(-z)$, аналитические на всей комплексной плоскости. Очевидное равенство $F(z) \cdot G(z) = 1$ в терминах соответствующих им рядов Тейлора выглядит так:

$$\exp(z) \cdot \exp(-z) = 1 \quad \Longleftrightarrow \quad \left(\sum_{n=0}^{+\infty} 1 \cdot \frac{z^n}{n!} \right) \cdot \left(\sum_{n=0}^{+\infty} (-1) \cdot \frac{z^n}{n!} \right) = 1.$$

Несложно убедиться, что это равенство оказывается справедливым и как соотношение между двумя элементами кольца $\mathbb{C}_e[[z]]$. Применяя теперь правило (37) умножения в кольце $\mathbb{C}_e[[z]]$, получаем хорошо известное и очень полезное тождество для биномиальных коэффициентов

$$\sum_{k=0}^n (-1)^k \binom{n}{k} = \begin{cases} 0, & \text{если } n > 0, \\ 1, & \text{если } n = 0. \end{cases}$$

Пример 6.7. Пусть $F(z), G(z)$ – пара аналитических функций, связанных в некоторой общей для них окрестности точки $z = 0$ тождеством вида

$$F(z) = G(z) \cdot e^z.$$

Очевидно, что тогда

$$G(z) = F(z) \cdot e^{-z}.$$

На языке формальных степенных рядов $F(z), G(z) \in \mathbb{C}_e[[z]]$ эти равенства отвечают формулам обращения

$$f_n = \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} g_k \quad \Longleftrightarrow \quad g_n = \sum_{k=0}^n (-1)^{n-k} \binom{n}{k} f_k.$$

Замечание 6.8. Подводя итоги, можно сказать, что описанный выше способ есть хороший способ *получения* разного рода соотношений между формальными степенными рядами. При этом, вообще говоря, это не есть способ их *доказательства* — по идее, мы обязательно должны затем проверить справедливость любого такого тождества, используя только лишь определение операций над формальными степенными рядами в соответствующем кольце формальных степенных рядов. Однако в случае, когда в полученных соотношениях фигурируют только лишь операции сложения и умножения, мы можем сразу сказать, что эти соотношения верны и как соотношения между формальными степенными рядами. Действительно, справедливость таких соотношений сразу следует из того факта, что операции сложения и умножения определены одинаково как в математическом анализе, так и в теории формальных степенных рядов.

6.3. Как уже неоднократно отмечалось, формула (40) указывает на то, что функции $f(z)$ и $g(z)$ являются взаимно-обратными по отношению к операции умножения в кольце формальных степенных рядов $\mathbb{C}[[z]]$. Возникает вопрос: какими свойствами должна обладать функция $g(z) \in \mathbb{C}[[z]]$ для того, чтобы она имела обратный по отношению к операции умножения элемент в кольце формальных степенных рядов $\mathbb{C}[[z]]$? Оказывается, необходимым и достаточным условием для этого является отличие коэффициента b_0 при $z^0 = 1$ от нуля.

6.3.1. Действительно, пусть $g(z) = b_0 + b_1 z + b_2 z^2 + \dots$ и коэффициент $b_0 \neq 0$. Покажем, что в этом случае обязательно существует функция $f(z) = a_0 + a_1 z + a_2 z^2 + \dots$, такая, что $f(z) \cdot g(z) = 1$.

Для этого перемножим два формальных степенных ряда $f(z)$ и $g(z)$, а затем приравняем в равенстве $f(z) \cdot g(z) = 1$ коэффициенты при одинаковых степенях z :

$$\begin{aligned} z^0 : \quad a_0 \cdot b_0 &= 1 & \implies & a_0 = \frac{1}{b_0} \neq 0; \\ z^1 : \quad a_0 \cdot b_1 + a_1 \cdot b_0 &= 0 & \implies & a_1 = -\frac{1}{b_0} \cdot (a_0 b_1); \\ z^2 : \quad a_0 \cdot b_2 + a_1 \cdot b_1 + a_2 \cdot b_0 &= 0 & \implies & a_2 = -\frac{1}{b_0} \cdot (a_0 b_2 + a_1 b_1); \\ & & & \dots \end{aligned}$$

Видно, что таким образом шаг за шагом можно восстановить все коэффициенты a_n формального степенного ряда $f(z)$.

Обратно, пусть $f(z) = a_0 + a_1 z + a_2 z^2 + \dots$ и $g(z) = b_0 + b_1 z + b_2 z^2 + \dots$ — обыкновенные производящие функции, такие, что $f(z) \cdot g(z) = 1$. Тогда, согласно формуле умножения обыкновенных производящих функций, $a_0 \cdot b_0 = 1$. Отсюда, в частности, следует, что $b_0 \neq 0$.

6.3.2. Пусть теперь $h(z) = c_0 + c_1 z + c_2 z^2 + \dots$ и $g(z) = b_0 + b_1 z + b_2 z^2 + \dots$ — два произвольных элемента кольца $\mathbb{C}[[z]]$, причем $b_0 \neq 0$. Пусть для определенности $b_0 = 1$. В этом случае можно рассматривать формальные дроби вида $h(z)/g(z)$ как элементы $f(z) \in \mathbb{C}[[z]]$, такие, что $f(z) \cdot g(z) = h(z)$. Говорят, что все эти элементы $f(z)$ образуют *поле частных* кольца $\mathbb{C}[[z]]$. По сути же дела, их можно рассматривать как результат *деления* формального степенного ряда $h(z)$ на формальный степенной ряд $g(z)$. Так, в рассмотренном в примере 6.5 ряд

$$f(z) = 1 + \alpha z + \alpha^2 z^2 + \dots$$

можно рассматривать как результат деления формальных степенных рядов $h(z) = 1$ и $g(z) = 1 - \alpha z$.

7 Производящие функции и линейные рекуррентные соотношения

7.1. Ранее мы научились по заданному линейному однородному рекуррентному соотношению с постоянными коэффициентами, связывающему члены a_n числовой последовательности, находить явные выражения для коэффициентов a_n как функций параметра n . Используя эти выражения, мы можем, в принципе, записать решение и в виде формального степенного ряда

$$f(z) = a_0 + a_1 z + a_2 z^2 + \dots + a_n z^n + \dots$$

Однако в большинстве задач такой порядок построения решения не является оптимальным. На практике, как правило, легче по имеющемуся рекуррентному соотношению построить соответствующую данной комбинаторной задаче производящую функцию, используя описанные в предыдущем параграфе операции над формальными степенными рядами. Проиллюстрируем вышесказанное на простом примере, описывающем изменение популяций лягушек в озере.

7.1.1. Напомним, что для этого примера нами было получено следующее линейное неоднородное рекуррентное соотношение первого порядка, описывающее изменение популяции лягушек в озере:

$$a_{n+1} = 4a_n - 100, \quad n = 0, 1, 2, \dots, \quad a_0 = 50. \quad (41)$$

Покажем, как восстановить для этой рекуррентной числовой последовательности отвечающую ей обыкновенную производящую функцию.

Пусть

$$f(z) = a_0 + a_1 z + a_2 z^2 + \dots + a_n z^n + \dots$$

есть искомая обыкновенная производящая функция для числовой последовательности a_n , удовлетворяющей уравнению (41). Домножим (41) на z^{n+1} и просуммируем полученное уравнение по n от 0 до $+\infty$:

$$\sum_{n=0}^{+\infty} a_{n+1} z^{n+1} = 4 \sum_{n=0}^{+\infty} a_n z^{n+1} - 100 \sum_{n=0}^{+\infty} z^{n+1}. \quad (42)$$

Левая часть этого равенства — это “почти” $f(z)$; переходя в этой сумме к новому индексу суммирования $k = n + 1$, $k = 1, \dots, +\infty$, получаем

$$\sum_{k=1}^{+\infty} a_k z^k = f(z) - a_0.$$

Первая сумма в правой части равенства (42), очевидно, равна

$$4 \sum_{n=0}^{+\infty} a_n z^{n+1} = 4z \sum_{n=0}^{+\infty} a_n z^n = 4z f(z).$$

Наконец, последнюю сумму в (42) можно свернуть и записать в виде дроби

$$\sum_{n=0}^{+\infty} z^{n+1} = z \sum_{n=0}^{+\infty} z^n = \frac{z}{1-z}.$$

Поэтому окончательно равенство (42) переписывается в виде

$$\begin{aligned} f(z) - a_0 &= 4z f(z) - 100 \frac{z}{1-z} \implies \\ \implies f(z) &= \frac{a_0}{1-4z} - \frac{100z}{(1-z)(1-4z)}. \end{aligned} \quad (43)$$

7.1.2. Итак, мы построили производящую функцию для числовой последовательности a_n . Наша же исходная задача заключалась в отыскании явного выражения для этих чисел. Оказывается, что теперь это сделать довольно просто — достаточно разложить правую часть (43) в ряд по степеням z .

С первым слагаемым в правой части (43) справиться легко — мы знаем, что

$$g(z) = \frac{1}{1-4z} = 1 + 4z + (4z)^2 + \dots$$

Для того, чтобы проделать ту же операцию со вторым слагаемым, нам предварительно необходимо разложить эту дробь на простейшие:

$$\frac{z}{(1-z)(1-4z)} = \frac{A}{1-z} + \frac{B}{1-4z} = \frac{A-4Az+B-Bz}{(1-z)(1-4z)} \implies \begin{cases} A+B=0 \\ 4A+B=-1 \end{cases} \implies \begin{cases} A=-1/3 \\ B=1/3 \end{cases}$$

Как следствие,

$$-\frac{100z}{(1-z)(1-4z)} = -\frac{100}{3} \left[\sum_{n=0}^{+\infty} (4^n - 1) z^n \right],$$

и мы окончательно для a_n получаем следующее явное аналитическое выражение:

$$a_n = a_0 4^n - \frac{100}{3} [4^n - 1] = \frac{50}{3} [4^n + 2], \quad n = 0, 1, 2, \dots$$