

Элементы теории игр

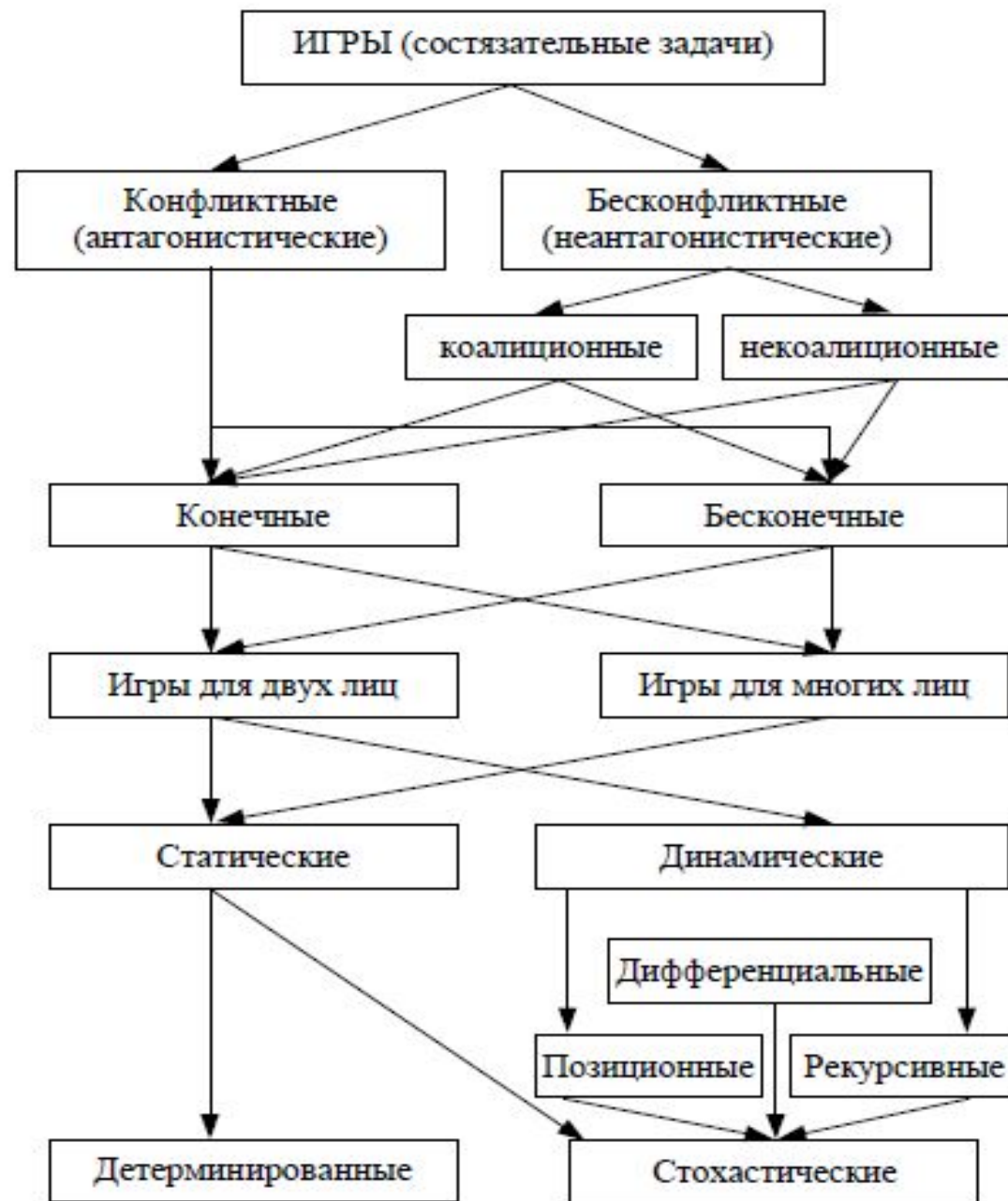
Конфликтные ситуации

- Ситуации, в которых сталкиваются две или более стороны, преследующие различные цели, причем результат, полученный каждой из сторон при реализации определенной стратегии, зависит от действий других сторон, называются **конфликтными** (борьба фирм за рынок сбыта, аукцион, спортивные состязания, военные операции, парламентские выборы (при наличии нескольких кандидатов), карточные игры)

Оптимизационные задачи теории игр

- решение принимает не одно, а два или более лиц, а результат решения зависит от совокупности решений всех ЭТИХ лиц
- каждому лицу не известны ни решения других лиц, ни вероятностные оценки их возможных решений

Классификация игровых задач



Игра с нулевой суммой

- конфликт двух участников с противоположными интересами, выигрыш одной стороны конфликта в точности совпадает с проигрышем другой стороны
- Участники игры — лица, принимающие решения, — называются **игроками**.
- Целевые функции называются **платежными функциями**, и считается, что они показывают выигрыш игрока.
- **Стратегия** игрока — это осознанный выбор одного из множества возможных вариантов его действий

Платежная матрица

- Стратегии первого игрока пронумеруем числами от 1 до m , а стратегии второго игрока — числами от 1 до n .
- Конечная игра с нулевой суммой однозначно определяется **платежной матрицей** (матрицей выигрышей)

$$П = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \dots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \dots & a_{2n} \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ a_{m1} & a_{m2} & \dots & a_{mn} \end{pmatrix}$$

- a_{ij} — платеж второго игрока первому

Правила игры

- Игра происходит партиями.
- **Партия** игры состоит в том, что игроки одновременно называют свой выбор: первый игрок называет некоторый номер строки матрицы Π (по своему выбору или случайно), а второй — некоторый номер столбца этой матрицы (также по своему выбору или случайно).
- После этого происходит «расплата».
- **Цель** каждого игрока — **выиграть как можно бóльшую сумму** в результате большого числа партий.

Решение игры

- *Решением* игры можно назвать любое описание того, каким образом должны вести себя игроки в той или иной игровой ситуации.
- Стратегия называется *чистой*, если выбор игрока неизменен от партии к партии. У первого игрока, очевидно, есть m чистых стратегий, а у второго - n .
- Решением может быть набор исходов игры.
- Решением игры может быть и набор смешанных стратегий, если одних только чистых стратегий недостаточно.

Игра в чистых стратегиях

- При анализе игр противник считается сильным, т.е. разумным.

- **Нижняя цена игры**

$$\alpha = \max_{I=1,2,\dots,m} \min_{J=1,2,\dots,n} a_{IJ}$$

представляет собой максимальный гарантированный выигрыш первого игрока. Стратегия 1-го игрока – максиминная.

- **Верхняя цена игры**

$$\beta = \min_{J=1,2,\dots,n} \max_{I=1,2,\dots,m} a_{IJ}$$

представляет собой величину, противоположную минимальному гарантированному проигрышу второго игрока (второй игрок гарантирует, что он не проиграет больше чем β). Стратегия 2-го игрока – минимаксная.

Цена игры

- Если $\alpha = \beta$, то говорят, что игра имеет **седловую точку в чистых стратегиях**.
- Общее значение α и β называется при этом **ценой игры** и обозначается $v = \alpha = \beta$.
- Стратегии игроков, соответствующие седловой точке, называются **оптимальными чистыми стратегиями**.
- **Теорема.** *В любой матричной игре нижняя цена не превосходит верхней: $\alpha \leq \beta$.*

Пример

- В платежной матрице

$$П = \begin{pmatrix} 0,1 & 0,2 & 0,4 \\ 0,5 & 0,3 & 0,4 \\ 0,3 & 0,1 & 0,2 \end{pmatrix}$$

указано, какую долю рынка выиграет предприятие у своего единственного конкурента, если оно будет действовать согласно каждой из возможных трех стратегий, а конкурент — согласно каждой из своих возможных трех стратегий. Требуется определить, имеет ли данная игра седловую точку в чистых стратегиях. Найти цену игры.

Решение

- Нижняя цена игры

$$\alpha = \max_{i=1,2,3} \min_{j=1,2,3} a_{ij} = \max\{0,1, 0,3, 0,1\} = 0,3$$

соответствует второй стратегии первого игрока.

- Верхняя цена игры

$$\beta = \min_{j=1,2,3} \max_{i=1,2,3} a_{ij} = \min\{0,5, 0,3, 0,4\} = 0,3$$

соответствует второй стратегии второго игрока.

Если первый игрок будет действовать со второй стратегией, а второй игрок — со второй стратегией, то игроки могут гарантировать себе: первый — выигрыш не менее $v = \alpha = \beta = 0,3 = 30\%$ рынка, а второй — что первый выиграет не более $v = 30\%$ рынка

Игра в смешанных стратегиях

- p_i – вероятность, с которой первый игрок выбирает свою i -ю стратегию

$$\mathbf{p} = \begin{pmatrix} p_1 \\ p_2 \\ \vdots \\ p_m \end{pmatrix},$$

- q_i – вероятность, с которой второй игрок выбирает свою i -ю стратегию

$$\mathbf{q} = \begin{pmatrix} q_1 \\ q_2 \\ \vdots \\ q_n \end{pmatrix}$$

- *Смешанной стратегией* первого игрока называется вектор где все $p_i \geq 0$ ($i = 1, 2, \dots, m$), а $\sum p_i = 1$, т.е. распределение вероятностей на множестве его чистых стратегий
- *Смешанной стратегией* второго игрока называется вектор где все $q_i \geq 0$ ($i = 1, 2, \dots, n$), а $\sum q_i = 1$,

Игра в смешанных стратегиях

- Если игроки играют со своими смешанными стратегиями $\mathbf{p}=(p_1, p_2, \dots, p_m)$ и $\mathbf{q}=(q_1, q_2, \dots, q_n)$ соответственно, то математическое ожидание выигрыша первого игрока равно математическому ожиданию проигрыша в

$$M(\mathbf{p}, \mathbf{q}) = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n p_i q_j a_{ij}$$

- Стратегии $\mathbf{p}^*=(p^*_1, p^*_2, \dots, p^*_m)$ и $\mathbf{q}^*=(q^*_1, q^*_2, \dots, q^*_n)$ называются **оптимальными смешанными стратегиями** соответственно первого и второго игрок

$$M(\mathbf{p}, \mathbf{q}^*) \leq M(\mathbf{p}^*, \mathbf{q}^*) \leq M(\mathbf{p}^*, \mathbf{q}).$$

- Если у обоих игроков есть оптимальные смешанные стратегии, то пара $(\mathbf{p}^*, \mathbf{q}^*)$ называется **решением игры** (или **седловой точкой в смешанных стратегиях**), а число $v = M(\mathbf{p}^*, \mathbf{q}^*)$ – **ценой игры**

Решение игры 2×2 в смешанных

стр

- Пусть $A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} \\ a_{21} & a_{22} \end{pmatrix}$ - матрица игры

- Пусть (p_1, p_2) – оптимальная стратегия игрока 1;
- (q_1, q_2) – оптимальная стратегия игрока 2
- Тогда, исключая тривиальный случай (наличие чистой оптимальной стратегии хотя бы у одного из игроков), имеем:
 - $p_1 + p_2 = 1, p_1 > 0, p_2 > 0;$
 - $q_1 + q_2 = 1, q_1 > 0, q_2 > 0;$

Решение игры 2×2 в смешанных стратегиях

• Цена игры игрока 1 равна:

$$\begin{cases} a_{11}p_1 + a_{12}p_2 = v, \\ a_{21}p_1 + a_{22}p_2 = v. \end{cases}$$

• Подставляя $p_2 = 1 - p_1$, находим $p_1 = \frac{a_{22} - a_{21}}{\Delta_A}$,

$$p_2 = 1 - p_1, \quad \Delta_A = (a_{11} + a_{22}) - (a_{12} + a_{21})$$

• Аналогично для второго игрока находим

$$q_1 = \frac{a_{22} - a_{12}}{\Delta_A},$$

$$q_2 = 1 - q_1, \quad \Delta_A = (a_{11} + a_{22}) - (a_{12} + a_{21})$$

Пример. Игра «Угадывание монеты»

- Правила игры таковы. Первый игрок прячет в кулаке одну из двух монет: 1 руб. или 5 руб. по своему выбору и незаметно от второго игрока, а второй игрок пытается угадать, какая монета спрятана, и если угадывает, то получает эту монету, в противном случае платит первому игроку 3 руб. Требуется доказать, что данная игра не имеет седловой точки в чистых стратегиях и найти решение игры в смешанных стратегиях.

Решение

- Платежная матрица имеет вид, $\Pi = \begin{pmatrix} -1 & 3 \\ 3 & -5 \end{pmatrix}$.
- Проверим, есть ли в игре седловая точка в чистых стратегиях.
- Нижняя цена игры $\alpha = \max_{i=1,2} \min_{j=1,2} a_{ij} = \max\{-1, -5\} = -1$
- Верхняя цена игры $\beta = \min_{j=1,2} \max_{i=1,2} a_{ij} = \min\{3, 3\} = 3,$
- $\alpha \neq \beta$, и седловой точки (в чистых стратегиях) в игре нет

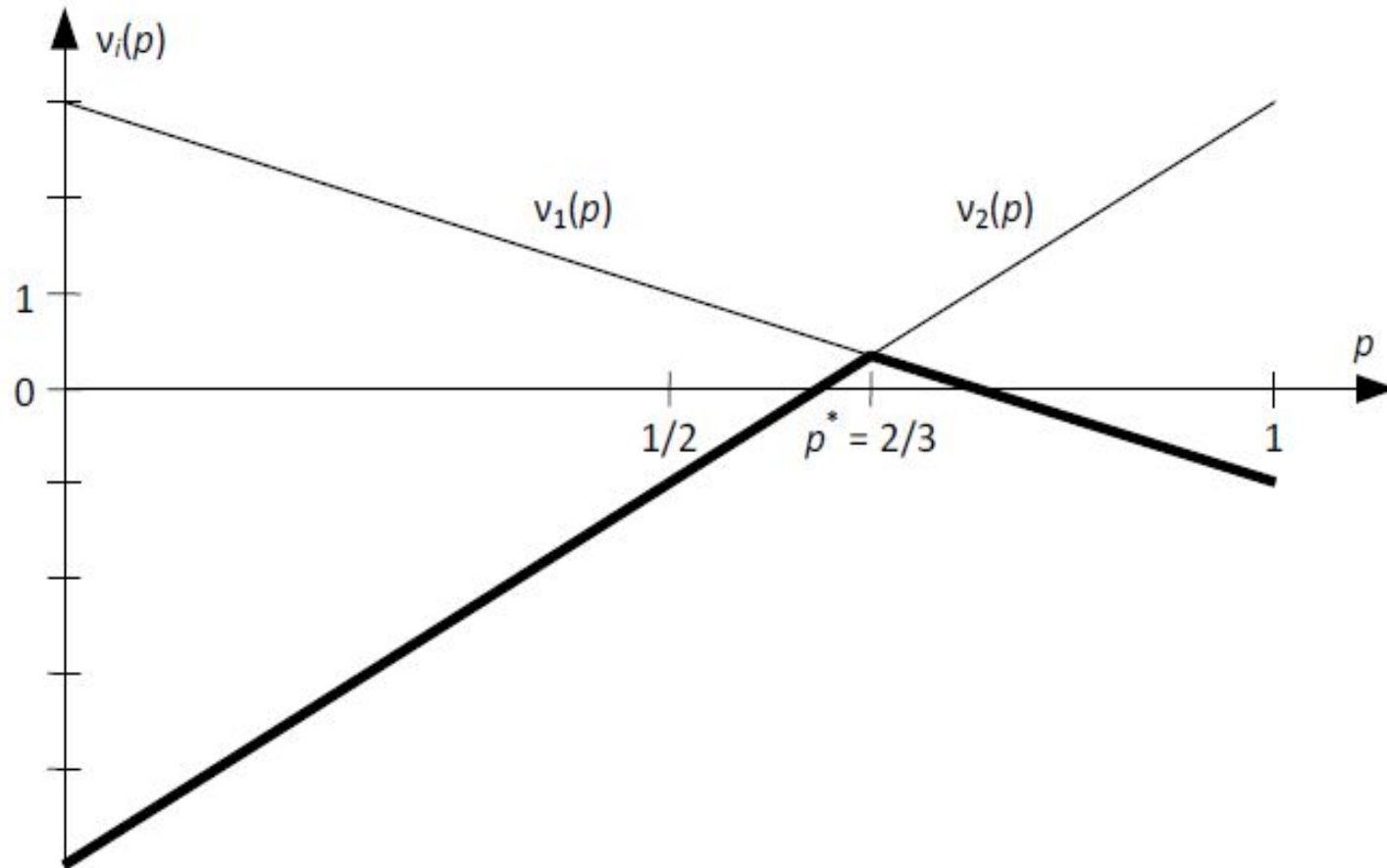
Решение в смешанных стратегиях для первого игрока

- Пусть первый игрок выбирает свою первую стратегию с вероятностью $p \in [0, 1]$, а вторую стратегию — соответственно с вероятностью $(1 - p)$, т. е. первый игрок играет со смешанной стратегией $\mathbf{p}^* = (p, 1-p)$.
- Обозначим $v_j(p)$ ожидаемый выигрыш (т. е. математическое ожидание выигрыша) первого игрока, если второй игрок при этом выберет свою j -ю стратегию.

$$v_1(p) = (-1)p + 3(1 - p),$$

$$v_2(p) = 3p + (-5)(1 - p).$$

Гарантированный выигрыш первого игрока



Решение в смешанных стратегиях для первого игрока

- Второй игрок так выбирает свои стратегии, чтобы обеспечить первому минимальный выигрыш:

$$v(p) = \min \{ v_1(p), v_2(p) \}.$$

Наилучший для первого игрока выбор соответствует $v^* = \max_{p \in [0;1]} v(p)$.

- Из условия $v_1(p) = v_2(p)$ или $-p + 3(1-p) = 3p - 5(1-p)$ находим

$$p = p^* = 2/3.$$

- Оптимальной смешанной стратегией первого игрока является стратегия

$$p^* = (2/3, 1/3).$$

- Цена игры равна $v^* = v_1(2/3) = v_2(2/3) = 1/3$.

Вне зависимости от того, какую стратегию выберет второй игрок, первый игрок будет выигрывать в среднем за большое число партий по 1/3 руб. за одну партию.

Решение в смешанных стратегиях для второго игрока

- Пусть второй игрок выбирает первую стратегию с вероятностью $q \in [0, 1]$, а вторую — с вероятностью $(1 - q)$,

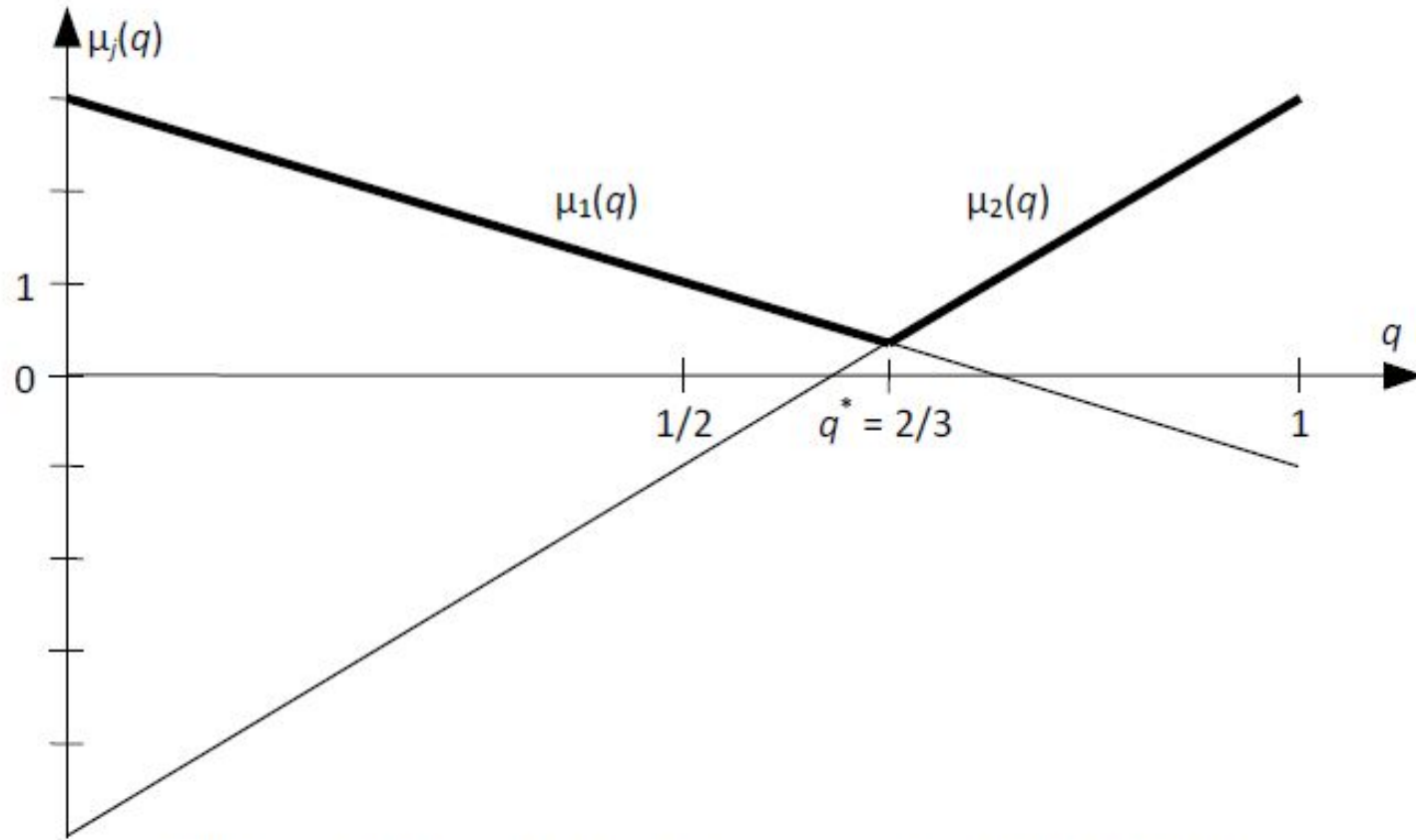
т.е. вектор смешанной стратегии второго игрока имеет вид $\mathbf{q} = (q, 1 - q)$.

- Проигрыш второго игрока равен

$\mu_1(q) = -q + 3(1 - q)$, если первый игрок выбирает свою первую стратегию

$\mu_2(q) = 3q - 5(1 - q)$, если первый игрок выбирает свою вторую стратегию

Верхняя граница проигрыша второго игрока



Решение в смешанных стратегиях для второго игрока

- Наилучшее с точки зрения второго игрока значение q определяется

$$\min_{q \in [0, 1]} \max \{ \mu_1(q), \mu_2(q) \}$$

- Из условия $\mu_1(q) = \mu_2(q)$ находим $q^* = 2/3$.
- Поэтому оптимальная смешанная стратегия второго игрока равна

$$q^* = (2/3, 1/3).$$

Основная теорема теории матричных игр

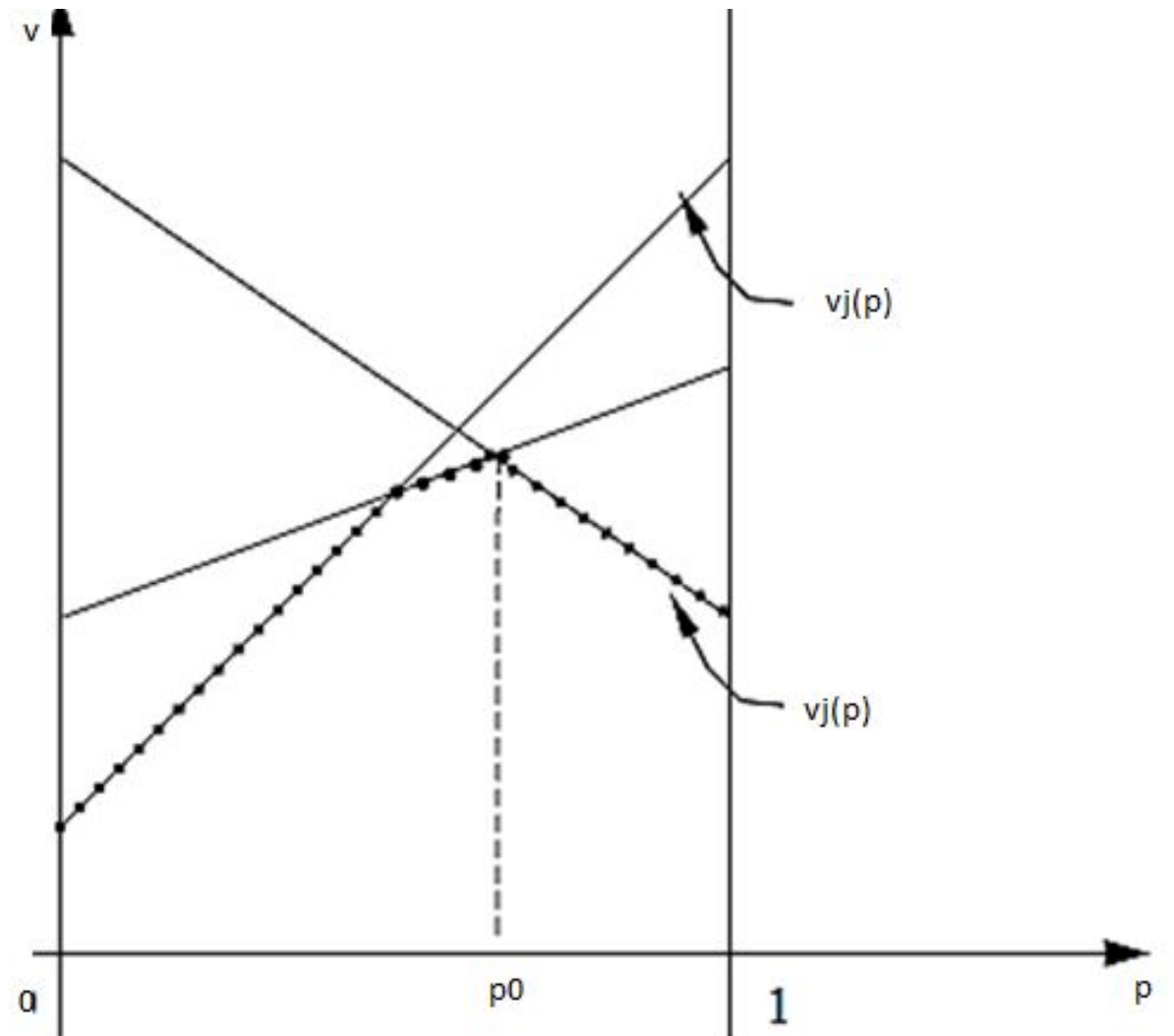
В любой матричной игре у игроков есть оптимальные смешанные стратегии.

Решение игры 2×n

- Матрица игры $A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \dots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \dots & a_{2n} \end{pmatrix}$
- Смешанные стратегии игрока 1 – вектор $\bar{p} = (p, 1-p)$
- Ожидаемый выигрыш 1-го игрока при применении игроком 2 своей j -ой стратегии:
- $$v_j = a_{1j}p + a_{2j}(1-p) = (a_{1j} + a_{2j})p + a_{2j}, \quad j = \overline{1, n}$$

Гарантированный выигрыш игрока 1

- Строим графики ожидаемых выигрышей и по графику устанавливаем точку M^* - верхнюю точку нижней огибающей данного семейства прямых, которая соответствует оптимальной стратегии первого игрока



Пример

- Решить игру с платежной матрицей

$$P = \begin{pmatrix} -2 & 3 & 4 & -1 \\ 2 & -4 & -3 & 1 \end{pmatrix}.$$

Решение в чистых стратегиях

- Нижняя цена игры $\alpha = \max_{i=1,2} \min_{j=1,2,3,4} a_{ij} = \max\{-2, -4\} = -2,$
- Верхняя цена игры $\beta = \min_{j=1,2,3,4} \max_{i=1,2} a_{ij} = \min\{2, 3, 4, 1\} = 1,$
- $\alpha \neq \beta$, значит, седловой точки (в чистых стратегиях) в игре нет

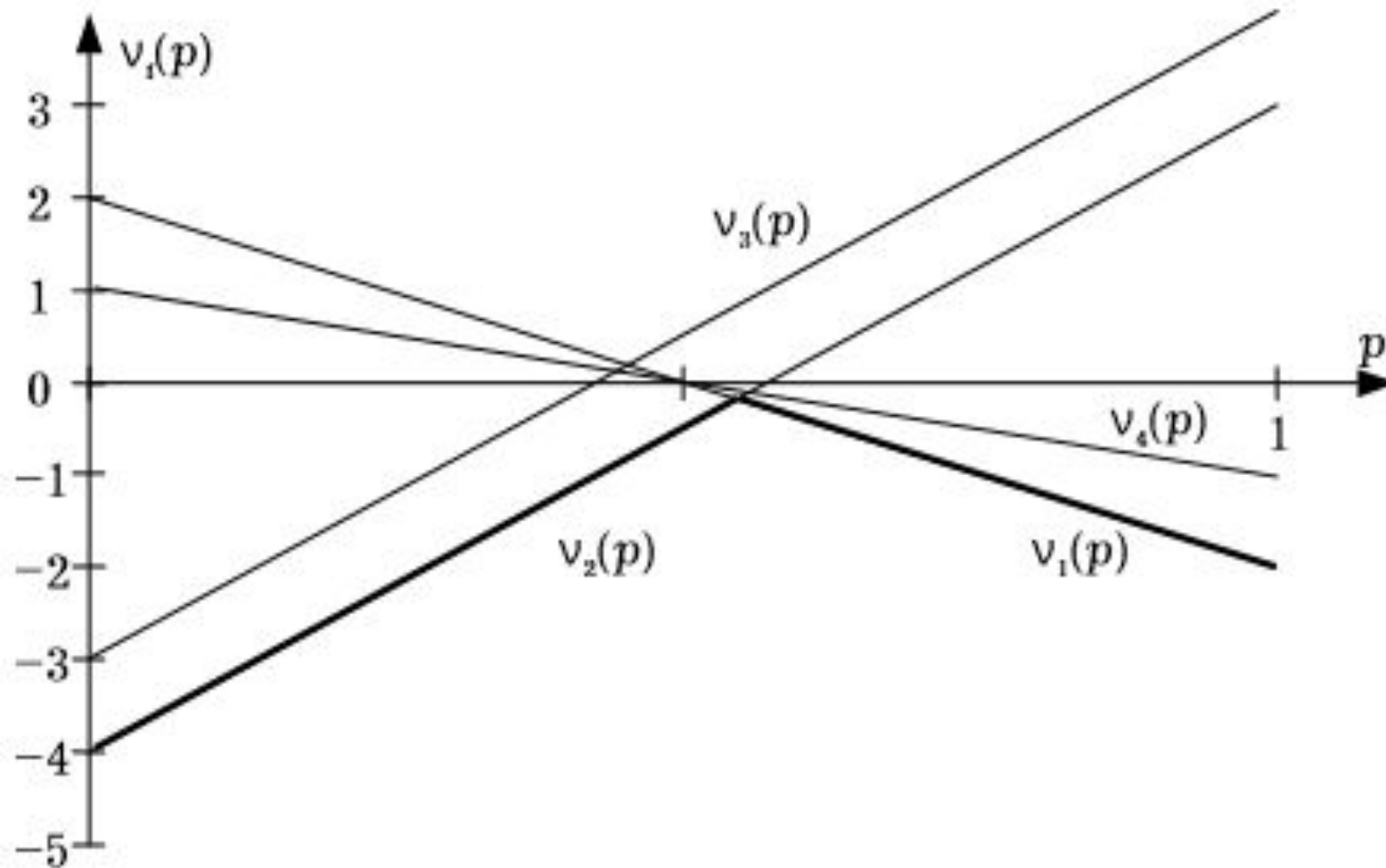
Решение в смешанных стратегиях для первого игрока

- Пусть первый игрок играет со смешанной стратегии $p = \begin{pmatrix} p \\ 1-p \end{pmatrix}$.
- Обозначим $v_j(p)$ ожидаемый выигрыш первого игрока, если второй игрок при этом выберет свою j -ю стратегию:

$$v_1(p) = (-2)p + 2(1-p), \quad v_2(p) = 3p + (-4)(1-p),$$

$$v_3(p) = 4p + (-3)(1-p), \quad v_4(p) = (-1)p + 1(1-p).$$

Гарантированный выигрыш первого игрока



Оптимальная стратегия первого игрока

- Из условия $v_1(p) = v_2(p)$ находим $p=6/11$,
т.е. оптимальная стратегия первого игрока равна $\mathbf{p}^* = \begin{pmatrix} 6/11 \\ 5/11 \end{pmatrix}$
- Цена игры равна $v^* = v_1(6/11) = v_2(6/11) = -2/11$.

Решение в смешанных стратегиях для первого игрока

- Второй игрок, действуя разумно, никогда не будет выбирать третью и четвертую стратегии, поэтому вектор оптимальной смешанной стратегии второго игрока имеет вид

$$q^* = \begin{pmatrix} q \\ 1-q \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}.$$

- Проигрыш второго игрока равен

$\mu_1(q) = -2q + 3(1-q)$, если первый игрок выбирает свою первую стратегию, $\mu_2(q) = 2q - 4(1-q)$, если первый игрок выбирает свою вторую стратегию.

Оптимальная стратегия второго игрока

- Из условия $\mu_1(q) = \mu_2(q)$ находим $q=7/11$.
- Оптимальная смешанная стратегия второго игрока равна

$$q^* = \begin{pmatrix} 7/11 \\ 4/11 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}.$$

Игра $m \times n$

При решении матричной игры размерностью $n \times m$ могут быть применены два приема:

- сведение задачи к задаче $m \times 2$ или $2 \times n$;
- сведение задачи к задаче линейного программирования.

Доминирующие стратегии

- Говорят, что **стратегия A1 первого игрока доминирует стратегию A2**, если для всех $j = 1, 2, \dots, n$ имеет место $a_{1j} \geq a_{2j}$. В этом случае стратегия A2 заведомо хуже стратегии A1. Стратегия A2 называется доминируемой и может быть исключена из рассмотрения.
- Говорят, что **стратегия B1 доминирует стратегию B2 второго игрока**, если для любого i справедливо $a_{i1} \leq a_{i2}$. Здесь стратегия B2 заведомо хуже стратегии B1, она называется доминируемой и может быть удалена из рассмотрения.

Основные теоремы теории игр

- Ни одна из строго доминирующих чистых стратегий не содержится в спектре оптимальных решений.
- Если некоторая чистая стратегия A , доминируется смешанной стратегией B , в спектре которой нет A , то удаление A приводит к тождественной игре.
- Решения игр будут тождественными, если каждый элемент платежной матрицы преобразуется следующим образом

$$p_{ij} = ka_{ij} + b, \text{ где } k > 0, b > 0 \text{ – любые числа.}$$

Без изменения оптимального решения каждый элемент платежной матрицы можно умножить на любое положительное число и сложить с любым положительным числом. При этом новая цена игры v будет связана с реальной ценой соотношением $v_{ij} = kv_{ij}^* + b$

Пример

- Решить игру, заданную платежной матрицей

	B1	B2	B3	B4	B5
A1	4	7	2	3	4
A2	3	5	6	8	9
A3	4	4	2	2	8
A4	3	6	1	2	4
A5	3	5	6	8	9

Решение

- Стратегия A5 дублирует стратегию A2, поэтому любую из них можно отбросить. Отбросим A5. Заметим, что в строке A1 все выигрыши больше (или равны) выигрышам строки A4. Стратегия A1 доминирует над стратегией A4. Отбрасываем строку A4. Получим игру 3×5.

	B1	B2	B3	B4	B5
A1	4	7	2	3	4
A2	3	5	6	8	9
A3	4	4	2	2	8

Решение

- Стратегия В3 доминирует над В4 и над В5, а В1 – над В2. Отбрасываем столбцы В2, В4, В5. Получим игру 3×2.

	В1	В3
А1	4	2
А2	3	6
А3	4	2

- Стратегия А3 дублирует стратегию А1, поэтому любую из них можно отбросить. Отбросим А3. Получим игру 2×2.

Постановка двойственных задач линейного программирования для первого и второго игроков

$$\sum_{i=1}^m y_i \rightarrow \min,$$

$$\sum_{i=1}^m a_{ij} y_i \geq 1, \quad j = 1, 2, \dots, n,$$

$$y_i \geq 0, \quad i = 1, 2, \dots, m.$$

$$\sum_{j=1}^n x_j \rightarrow \max,$$

$$\sum_{j=1}^n a_{ij} x_j \leq 1, \quad i = 1, 2, \dots, m,$$

$$x_j \geq 0, \quad j = 1, 2, \dots, n.$$

Оптимальные смешанные стратегии игроков

- Цена игры

$$v^* = \frac{1}{\sum_{i=1}^m x_i^*} = \frac{1}{\sum_{j=1}^n y_j^*},$$

- Оптимальные смешанные стратегии игроков

$$p^* = v^* y^* = \frac{1}{\sum_{i=1}^m y_i^*} \begin{pmatrix} y_1^* \\ y_2^* \\ \vdots \\ y_m^* \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} y_1^* / \sum_{i=1}^m y_i^* \\ y_2^* / \sum_{i=1}^m y_i^* \\ \vdots \\ y_m^* / \sum_{i=1}^m y_i^* \end{pmatrix} \quad \text{и} \quad q^* = v^* x^* = \frac{1}{\sum_{j=1}^n x_j^*} \begin{pmatrix} x_1^* \\ x_2^* \\ \vdots \\ x_n^* \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x_1^* / \sum_{j=1}^n x_j^* \\ x_2^* / \sum_{j=1}^n x_j^* \\ \vdots \\ x_n^* / \sum_{j=1}^n x_j^* \end{pmatrix}.$$

Замечание

- Если же в платежной матрице есть отрицательные элементы или нули, то можно добавить ко всем элементам матрицы одно и то же достаточно большое положительное число b , так чтобы все элементы матрицы стали положительными, затем поставить и решить пару двойственных задач линейного программирования, найти оптимальные смешанные стратегии игроков, а цену игры скорректировать путем вычитания из нее числа b .

Пример

- В условиях предыдущего примера решить игру с платежной матрицей сведением ее к задаче линейного программирования

$$P = \begin{pmatrix} -2 & 3 & 4 & -1 \\ 2 & -4 & -3 & 1 \end{pmatrix}.$$

Решение с помощью сведения задачи к паре взаимно двойственных задач линейного программирования

- От платежной матрицы $\Pi = \begin{pmatrix} -2 & 3 & 4 & -1 \\ 2 & -4 & -3 & 1 \end{pmatrix}$

путем добавления положительного числа $b = 5$ перейдем к матрице

$$\Pi' = \begin{pmatrix} 3 & 8 & 9 & 4 \\ 7 & 1 & 2 & 6 \end{pmatrix}$$

Пара двойственных задач линейного программирования

$$y_1 + y_2 \rightarrow \min,$$

$$\begin{cases} 3y_1 + 7y_2 \geq 1, \\ 8y_1 + y_2 \geq 1, \\ 9y_1 + 2y_2 \geq 1, \\ 4y_1 + 6y_2 \geq 1, \end{cases}$$

$$y_1 \geq 0, y_2 \geq 0.$$

$$x_1 + x_2 + x_3 + x_4 \rightarrow \max,$$

$$\begin{cases} 3x_1 + 8x_2 + 9x_3 + 4x_4 \leq 1, \\ 7x_1 + x_2 + 2x_3 + 6x_4 \leq 1, \end{cases}$$

$$x_1 \geq 0, x_2 \geq 0, x_3 \geq 0, x_4 \geq 0.$$

Оптимальные решения

- Оптимальные решения задач Л $y^* = \begin{pmatrix} 6/53 \\ 5/53 \end{pmatrix}$ и $x^* = \begin{pmatrix} 7/53 \\ 4/53 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$,
- Оптимальные смешанные стратегии игроков

$$p^* = \frac{1}{6/53 + 5/53} \begin{pmatrix} 6/53 \\ 5/53 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 6/11 \\ 5/11 \end{pmatrix}$$

$$q^* = \frac{1}{7/53 + 4/53 + 0 + 0} \begin{pmatrix} 7/53 \\ 4/53 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 7/11 \\ 4/11 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix},$$

- Цена игры $v^* = \frac{1}{6/53 + 5/53} - 5 = -2/11.$