

SOAS – Blatt 7 Aufgabe 2

Andreas Knote
Birgit Kühbacher
Christopher Stifter

WS 16/17
Selbst-organisierende, adaptive Systeme
Universität Augsburg



Kern und Koalitionen

„Ein Projekt wird mit Leistungspunkten bewertet. Studentinnen und Studenten können in 3-er Teams zusammenarbeiten und erhalten Punkte als Gruppe, die sie danach beliebig aufeinander verteilen können.

Je eine Person kann keine Punkte erwirtschaften, je 2 schaffen 4 LP und alle zusammen 6 LP.

*Geben Sie wiederum die **charakteristische Funktion** an und bestimmen **eine Auszahlung im Kern**.“*

$$v: 2^N \rightarrow \mathbb{R}$$

$$v := \begin{cases} \{\emptyset\} \rightarrow 0 \\ \{S \subset N \mid |S| = 1\} \rightarrow 0 \\ \{S \subset N \mid |S| = 2\} \rightarrow 4 \\ \{S \subset N \mid |S| = 3\} \rightarrow 6 \end{cases}$$

Die charakteristische Funktion gibt die **Payoffs für bestimmte Koalitionen** zwischen Spielern an.

In diesem Fall ist sie abhängig allein von der Koalitionsgröße.

$$x \in \text{Kern}(v): \forall S \subseteq N: \sum_{i \in S} x_i \geq v(S)$$

- Eine Auszahlung im Kern berücksichtigt individuelle und kollektive Rationalität.
- Der Kern kann leer sein oder mehrere Auszahlungen enthalten, in welchem Fall die Lösung des kooperativen Spiels nicht eindeutig ist.
- Eine Auszahlung im Kern führt zu einer stabilen Koalition.

$$x^a = (2,2,2)$$

$$|S| = 0: \sum_{i \in S} x_i^a = 0 \geq 0 = v(S)$$

$$|S| = 1: \sum_{i \in S} x_i^a = 2 \geq 0 = v(S)$$

$$|S| = 2: \sum_{i \in S} x_i^a = 4 \geq 4 = v(S)$$

$$|S| = 3: \sum_{i \in S} x_i^a = 6 \geq 6 = v(S)$$

Es muss gelten:

$$x_1 + x_2 + x_3 = 6$$

Weiterhin:

$$\begin{aligned} x_1 + x_2 &\geq 4 \\ \Leftrightarrow 6 - x_2 - x_3 + x_2 &\geq 4 \\ \Rightarrow x_3 &\leq 2 \end{aligned}$$

Analog

$$x_2 \leq 2$$

$$\begin{aligned} x_2 + x_3 &\geq 4 \Rightarrow x_2 = x_3 = 2 \\ \Rightarrow x_1 &= 2 \end{aligned}$$

„Berechnen Sie den **Shapley-Wert** für das vorherige Beispiel.“

$$\phi(V) = \frac{1}{|N|!} \sum_{S \subseteq N \setminus \{i\}} |S|! (|N| - |S| - 1)! (v(S \cup \{i\}) - v(S))$$

- Der Shapely-Wert ist die Auszahlungsfunktion, die zu einer fairen Verteilung führt.
- Sie muss jedoch nicht zwingend auch zu einer stabilen großen Koalition führen, da Individualgewinne in anderen Koalitionen höher sein können.

$$\begin{aligned}\phi_i(V) &= \frac{1}{|N|!} \sum_{S \subseteq N \setminus \{i\}} |S|! (|N| - |S| - 1)! (v(S \cup \{i\}) - v(S)) \\ &= \frac{1}{6} (0! (3 - 1)! (v(\emptyset \cup \{i\}) - v(\emptyset)) + \dots) \\ &= \frac{1}{6} (0 + 2 \cdot 4 + 4) = \frac{12}{6} = 2\end{aligned}$$

Es gilt wg. Symmetrie der char. Funktion in i $\phi_1(V) = \phi_2(V) = \phi_3(V)$

$$\phi(V) = (\phi_1(V), \phi_1(V), \phi_1(V)) = (2, 2, 2)$$

Auszahlung aus a) also **fair (Shapley)** und **stabil (im Kern)**.

“Nehmen Sie an, 3 Agenten ($N = \{1, 2, 3\}$) können gemeinsam 100% Werbereichweite erreichen, je 2 schaffen 80% und einer alleine 0%.

Es sei ein bestimmter Betrag von x Euro bei 100% Reichweite erreichbar (der Wert der großen Koalition).

Auszuzahlen ist ein relativer Anteil von x , also Werte zwischen 0 und 1 für alle Agenten in N .

Formalisieren Sie diese Situation mittels der charakteristischen Funktion und geben sie eine Auszahlung (also einen Vektor x mit $x_1 + x_2 + x_3 = 1$) im Kern an.“

$$v: 2^N \rightarrow \mathbb{R}$$

$$v := \begin{cases} \{\emptyset\} \rightarrow 0 \\ \{S \subset N \mid |S| = 1\} \rightarrow 0 \\ \{S \subset N \mid |S| = 2\} \rightarrow 0.8x \\ \{S \subset N \mid |S| = 3\} \rightarrow x \end{cases}$$

$$\begin{aligned}\phi_i(V) &= \frac{1}{|N|!} \sum_{S \subseteq N \setminus \{i\}} |S|! (|N| - |S| - 1)! (v(S \cup \{i\}) - v(S)) \\ &= \frac{1}{6} (1 \cdot 2 \cdot 0 + 2 \cdot 1 \cdot 1 \cdot (0.8x - 0)) + 2 \cdot 1 \cdot (x - 0.8x) \\ &= \frac{1}{3}x\end{aligned}$$

Payoff der großen Koalition wird fair aufgeteilt, ist jedoch nicht stabil, denn x^ϕ liegt nicht im Kern:

$$\begin{aligned}x^\phi &= \left(\frac{x}{3}, \frac{x}{3}, \frac{x}{3}\right) \\ S \text{ bel. mit } |S| = 2: \quad \sum x_i^\phi &= \frac{2}{3}x < v(S) = 0.8x\end{aligned}$$

Gibt es eine Auszahlung im Kern?

- $x_i = 1$ für ein beliebiges, festes i :
 - S mit $|S| = 2, i \notin S$: $\sum_{j \in S} x_j = 0 < v(S) = 0.8x$
- $x_{i,k} > 0, x_i + x_k = 1$, für beliebige, feste i, k :
 - S mit $|S| = 2, i \notin S$: $\sum_{j \in S} x_j = x_k < v(S) = 0.8x$
 - Oder S mit $|S| = 2, k \notin S$: $\sum_{j \in S} x_j = x_i < v(S) = 0.8x$

Das funktioniert so nicht!

Gegeben $a, b, c \in \mathbb{R}_+$, mit

$$a + b + c = 1,$$

$$a + b \geq 0.8 \text{ (I),}$$

$$b + c \geq 0.8 \text{ (II),}$$

$$a + c \geq 0.8 \text{ (III).}$$

$$\begin{aligned} a &= 1 - b - c \\ \Rightarrow 1 - c - b + b &\geq 0.8 \Leftrightarrow c \leq 0.2 \end{aligned}$$

$$b = 1 - a - c \Rightarrow b \leq 0.2$$

$$c = 1 - a - b \Rightarrow a \leq 0.2$$

Daraus folgt: $a + b + c \leq 0.6$



„Nehmen Sie an, dass Koalitionen aus einem Kapitalisten (c) und zwei Arbeitern (w_1 und w_2) gebildet werden.

Um produktiv zu werden, muss eine **Mischung aus Arbeitern und Kapitalisten** gewählt werden (nur Kapitalist oder nur Arbeiter ergibt Wert 0).“

Charakteristische Funktion $v: 2^N \rightarrow \mathbb{R}$:

$$v := \begin{cases} \{\emptyset\} \rightarrow 0 \\ \{S \subset N \mid |S| = 1\} \rightarrow 0 \\ \{S \subset N \mid |S| = 2, c \notin S\} \rightarrow 0 \\ \{S \subset N \mid |S| = 2, c \in S\} \rightarrow 3 \\ \{S \subset N \mid |S| = 3\} \rightarrow 4 \end{cases}$$

- $x_1 = (2,1,1)$ ● liegt im Kern
- $x_2 = (2.5,0.5,1)$ ● liegt im Kern
- $x_3 = (4,0,0)$ ● liegt im Kern

$$\phi_c(V) = \frac{1}{6} ($$

0	$S = \emptyset$
$+ 2 \cdot 1 \cdot 1 \cdot (3 - 0)$	$S = \{w_1\}, \{w_2\}$
$+ 2 \cdot 1(4 - 0)$	$S = \{w_1, w_2\}$

$$) = \frac{14}{6}$$

$$\phi_{w_i}(V) = \frac{1}{6} ($$

0	$S = \emptyset$
$+ 1 \cdot 1 \cdot (0 - 0)$	$S = \{w_j\}$
$+ 1 \cdot 1 \cdot (3 - 0)$	$S = \{c\}$
$+ 2 \cdot 1(4 - 0)$	$S = \{w_j, c\}$

$$) = \frac{5}{6}$$

„Bestimmen Sie die optimale Koalitionsstruktur [...] mittels des DP-Algorithmus.“

$$N = \{1,2,3,4\}$$

$$v := \left\{ \begin{array}{l} \{\emptyset\} \rightarrow 0 \\ \{1\} \rightarrow 5 \quad \{2\} \rightarrow 4 \quad \{3\} \rightarrow 6 \quad \{4\} \rightarrow 4 \\ \{1,2\} \rightarrow 7 \quad \{1,3\} \rightarrow 8 \quad \{1,4\} \rightarrow 9 \\ \{2,3\} \rightarrow 10 \quad \{2,4\} \rightarrow 9 \quad \{3,4\} \rightarrow 6 \\ \{1,2,3\} \rightarrow 14 \quad \{1,2,4\} \rightarrow 12 \quad \{2,3,4\} \rightarrow 15 \quad \{1,3,4\} \rightarrow 17 \\ \{1,2,3,4\} \rightarrow 18 \end{array} \right.$$

c	v	f	t(c)	f(c)
{1}		5	{1}	5
{2}		4	{2}	4
{3}		6	{3}	6
...				
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3}, {4}	10
...				
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1}, {2,4}	14
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17
...				
{1,2,3,4}	18	$f(\{1\}, \{2,3,4\}) = 5 + 15 = 20$ $f(\{2\}, \{1,3,4\}) = 4 + 17 = 21$ $f(\{3\}, \{1,2,4\}) = 6 + 14 = 20$ $f(\{4\}, \{1,2,3\}) = 15 + 4 = 19$ $f(\{1,2\}, \{3,4\}) = 9 + 10 = 19$ $f(\{1,3\}, \{2,4\}) = 9 + 11 = 20$ $f(\{2,3\}, \{1,4\}) = 10 + 9 = 19$	{2}, {1,3,4}	21

c	v	f	t(c)	f(c)
{1}		5	{1}	5
{2}		4	{2}	4
{3}		6	{3}	6
...				
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3}, {4}	10
...				
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1}, {2,4}	14
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17
...				
{1,2,3,4}	18	$f(\{1\}, \{2,3,4\}) = 5 + 15 = 20$ $f(\{2\}, \{1,3,4\}) = 4 + 17 = 21$ $f(\{3\}, \{1,2,4\}) = 6 + 14 = 20$ $f(\{4\}, \{1,2,3\}) = 15 + 4 = 19$ $f(\{1,2\}, \{3,4\}) = 9 + 10 = 19$ $f(\{1,3\}, \{2,4\}) = 9 + 11 = 20$ $f(\{2,3\}, \{1,4\}) = 10 + 9 = 19$	{2}, {1,3,4}	21

Betrachtete Koalition

c	v	f	t(c)	f(c)
{1}	5		{1}	5
{2}	4		{2}	4
{3}	6		{3}	6
...				
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3}, {4}	10
...				
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1}, {2,4}	14
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17
...				
{1,2,3,4}	18	$f(\{1\}, \{2,3,4\}) = 5 + 15 = 20$ $f(\{2\}, \{1,3,4\}) = 4 + 17 = 21$ $f(\{3\}, \{1,2,4\}) = 6 + 14 = 20$ $f(\{4\}, \{1,2,3\}) = 15 + 4 = 19$ $f(\{1,2\}, \{3,4\}) = 9 + 10 = 19$ $f(\{1,3\}, \{2,4\}) = 9 + 11 = 20$ $f(\{2,3\}, \{1,4\}) = 10 + 9 = 19$	{2}, {1,3,4}	21

Zielfunktionswert

C	v	f	t(c)	f(c)
{1}		5	{1}	5
{2}		4	{2}	4
{3}		6	{3}	6
...				
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3}, {4}	10
...				
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1}, {2,4}	14
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17
...				
{1,2,3,4}	18	$f(\{1\}, \{2,3,4\}) = 5 + 15 = 20$ $f(\{2\}, \{1,3,4\}) = 4 + 17 = 21$ $f(\{3\}, \{1,2,4\}) = 6 + 14 = 20$ $f(\{4\}, \{1,2,3\}) = 15 + 4 = 19$ $f(\{1,2\}, \{3,4\}) = 9 + 10 = 19$	{2}, {1,3,4}	21

Vergleich mit vorherigen Koalitionen

C	v	f	t(c)	f(c)
{1}		5	{1}	5
{2}		4	{2}	4
{3}		6	{3}	6
...				
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3}, {4}	10
...				
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1}, {2,4}	14
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17
...				
{1,2,3,4}	18	$f(\{1\}, \{2,3,4\}) = 5 + 15 = 20$ $f(\{2\}, \{1,3,4\}) = 4 + 17 = 21$ $f(\{3\}, \{1,2,4\}) = 6 + 14 = 20$ $f(\{4\}, \{1,2,3\}) = 15 + 4 = 19$ $f(\{1,2\}, \{3,4\}) = 9 + 10 = 19$	{2}, {1,3,4}	21

Vergleich mit vorherigen Koalitionen

c	v	f	t(c)	f(c)
{1}		5	{1}	5
{2}		4	{2}	4
{3}		6	{3}	6
...				
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3}, {4}	10
...				
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1}, {2,4}	14
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17
...				
{1,2,3,4}	18	$f(\{1\}, \{2,3,4\}) = 5 + 15 = 20$ $f(\{2\}, \{1,3,4\}) = 4 + 17 = 21$ $f(\{3\}, \{1,2,4\}) = 6 + 14 = 20$ $f(\{4\}, \{1,2,3\}) = 15 + 4 = 19$ $f(\{1,2\}, \{3,4\}) = 9 + 10 = 19$	{2}, {1,3,4}	21

Optimale Koalitionen und Wert

Dynamische Programmierung (Excel)



„Weisen Sie zudem nach, dass die Anzahl der Operationen in $O(3n)$ liegt.“

C	v	f	t(c)	f(c)
{1}		5	{1}	5
{2}		4	{2}	4
{3}		6	{3}	6
...				
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3},{4}	10
...				
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1},{2,4}	14
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17
...				
{1,2,3,4}	18	$f(\{1\}, \{2,3,4\}) = 5 + 15 = 20$ $f(\{2\}, \{1,3,4\}) = 4 + 17 = 21$ $f(\{3\}, \{1,2,4\}) = 6 + 14 = 20$ $f(\{4\}, \{1,2,3\}) = 15 + 4 = 19$	{2},{1,3,4}	21

Je $\binom{n}{s}$ Koalitionen von Größe s

Je $\binom{n}{s}$ Koalitionen von Größe s

C	v	f	t(c)	f(c)
{1}		5	{1}	5
{2}		4	{2}	4
{3}		6	{3}	6
		...		
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3}, {4}	10
		...		
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1}, {2,4}	14
		...		
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17
		...		
{1,2,3,4}	18	$f(\{1\}, \{2,3,4\}) = 5 + 15 = 20$ $f(\{2\}, \{1,3,4\}) = 4 + 17 = 21$ $f(\{3\}, \{1,2,4\}) = 6 + 14 = 20$ $f(\{4\}, \{1,2,3\}) = 15 + 4 = 19$	{2}, {1,3,4}	21

Je 2^{s-1} Zerlegungen sind zu vergleichen

c	v	f	t(c)	f(c)
{1}		5	{1}	5
{2}		4	{2}	4
{3}		6	{3}	6
...				
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3}, {4}	10
...				
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1}, {2,4}	14
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17
...				
{1,2,3,4}	18	$f(\{1\}, \{2,3,4\}) = 5 + 15 = 20$ $f(\{2\}, \{1,3,4\}) = 4 + 17 = 21$ $f(\{3\}, \{1,2,4\}) = 6 + 14 = 20$ $f(\{4\}, \{1,2,3\}) = 15 + 4 = 19$	{2}, {1,3,4}	21

$$\sum_{s=1}^n \binom{n}{s} (2^{s-1}) \text{ Vergleiche insgesamt}$$

$$(a + b)^n = \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} (a^k b^{n-k})$$

Für $a = 2$ und $b = 1$ gilt:

$$3^n = \sum_{k=0}^n \binom{n}{k} 2^k \quad (I)$$

$$\sum_{s=1}^n \binom{n}{s} (2^{s-1}) = \frac{1}{2} \sum_{s=1}^n \binom{n}{s} (2^s) = \frac{1}{2} \sum_{s=0}^n \binom{n}{s} (2^s) - \frac{1}{2} \binom{n}{0} 2^0 \quad (II)$$

(I) in (II) mit Parametersubstitution s für k ergibt:

$$\frac{1}{2} 3^n - \frac{1}{2} \binom{n}{0} 2^0 = \frac{1}{2} (3^n - 1)$$

c	v	f	t(c)	f(c)
{1}		5	{1}	5
{2}		4	{2}	4
{3}		6	{3}	6
...				
{2,4}	9	8	{2,4}	9
{3,4}	6	10	{3}, {4}	10
...				
{1,2,4}	12	$f(\{1\}) + f(\{2,4\}) = 5 + 9 = 14$ $f(\{1,2\}) + f(\{4\}) = 9 + 4 = 13$ $f(\{1,4\}) + f(\{2\}) = 9 + 4 = 13$	{1}, {2,4}	14
{1,3,4}	17	$f(\{1\}) + f(\{3,4\}) = 5 + 10 = 15$ $f(\{1,3\}) + f(\{4\}) = 11 + 4 = 15$ $f(\{1,4\}) + f(\{3\}) = 9 + 6 = 15$	{1,3,4}	17

$$\sum_{s=1}^n \binom{n}{s} (2^{s-1}) = \frac{1}{2} (3^n - 1)$$

$$\Rightarrow \mathcal{O}(3^n)$$