

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«Московский государственный технический университет имени Н.Э. Баумана

(национальный исследовательский университет)» (МГТУ им. Н.Э. Баумана)

ФАКУЛЬТЕТ КАФЕДРА Информатика и системы управления (ИУ) Информационная безопасность (ИУ8)

Теория игр и исследование операций

Рубежный контроль №1 «Монотонный итеративный алгоритм»

Вариант: 1

Студент:	
Александров Алексей Николаевич, группа ИУ8-104	
(5 курс)	(подпись, дата)
Преподаватель:	
к.т.н., доцент кафедры ИУ8	
Коннова Наталья Сергеевна	(подпись, дата)

Оглавление

Цель работы	3
Задание	3
Ход работы	
Вывод	10
ПРИЛОЖЕНИЕ А Листинг исхолного кола реализации алгоритма	11

Цель работы

Изучить монотонный итеративный алгоритм решения антагонистической игры двух лиц в нормальной форме.

Задание

Для приведённой ниже матрицы стратегий найти цену игры и оптимальные стратегии обоих игроков монотонным итеративным методом.

$$\begin{pmatrix} 1 & 11 & 11 \\ 7 & 5 & 8 \\ 16 & 6 & 2 \end{pmatrix}$$

Ход работы

Для реализации решения рубежного контроля был использован язык программирования Python. К проверке представляется интерактивный блокнот Jupyter Notebook в файле monotonic_algorythm.ipynb, и импортированный файл *monotonic* (см. приложение A).

Инициализация матрицы представлена на рисунке 1. Нижняя и верхняя цены игры: 5 и 11. Седловой точки нет. Для однозначной идентификации назовём игроков A и B.

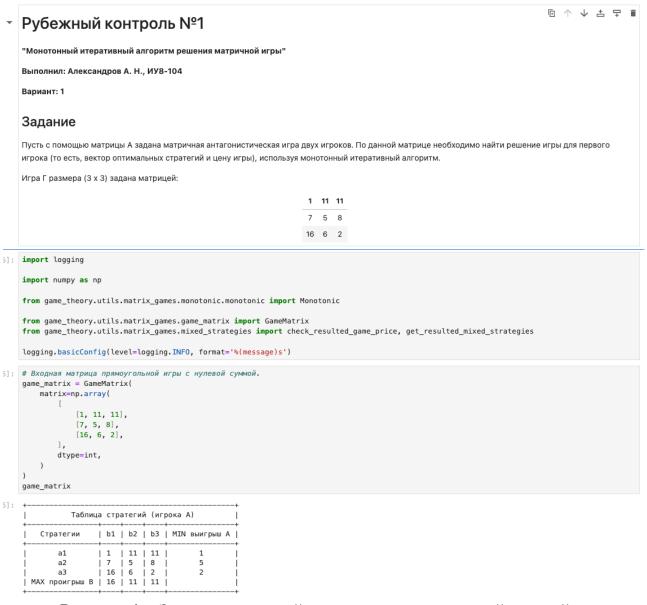


Рисунок 1 – Задание исходной матрицы игры с нулевой суммой

В данном случае доминируемых стратегий нет (см. рисунок 2), поэтому перейдём сразу к решению игры в смешанных стратегиях.

Рисунок 2 – Проверка отсутствия доминируемых стратегий

Далее приводится вывод программы для решения игры. Подыгры в методе решались сведением матричной игры к симплекс-методу. Промежуточные симплекс-таблицы опущены, чтобы не нагромождать листинг. Чистая стратегия на первой итерации выбирается случайно.

```
Решение игры относительно игрока А
Итерация 0:
      x^0 = [0 \ 0 \ 1]
      c^0 = [16. 6. 2.]
      v^0 = 2.0
      J^0 = [3]
<u>Итерация 1:</u>
Рассмотрим подыгру Г^1:
[[11.]
 [ 8.]
 [ 2.]]
Седловая точка найдена: (11.0, [1, 0, 0])
Оптимальная стратегия игрока:
      Находим оптимальную стратегию игрока в подыгре из двух строк:
[[16. 6. 2.]
[ 1. 11. 11.]]
Удаление NBR-стратегий ['b2']
Матрица после уменьшения размерности:
[[16. 2.]
[ 1. 11.]]
        Si0
                   х4
                              х3
 x1 | 0.0575 |
                0.0057 | -0.0632
 x2 | 0.0805 | -0.0920 |
                            0.0115
 F | 0.1379 | -0.0862 | -0.0517
Оптимальное решение найдено!
x4 = x3 = 0, x1 = 0.057, x2 = 0.080
Целевая функция: F = 0.138
В результате получена оптимальная стратегия: (\alpha_1, 1 - \alpha_1) = [0.583 \ 0.417]
```

```
x^1 = [0.583 \ 0.
                          0.417]
      c^1 = [7.251 \ 8.917 \ 7.25]
      v^1 = 7.25
      J^1 = [3]
Итерация 2:
Рассмотрим подыгру Г^2:
[[11.]]
 [ 8.]
 [ 2.]]
Седловая точка найдена: (11.0, [1, 0, 0])
Оптимальная стратегия игрока:
      -x_2 = [1 \ 0 \ 0]
       _c_2 = [ 1. 11. 11.]
Находим оптимальную стратегию игрока в подыгре из двух строк:
[[ 7.251 8.917 7.25 ]
 [ 1.
         11.
                11.
                      11
Удаление NBR-стратегий ['b2']
Матрица после уменьшения размерности:
[[ 7.251 7.25 ]
 [ 1.
         11.
               ]]
        Si0
                    x4
                              х3
       0.1379 |
                  0.0138
                           -0.1517
  x2 | 0.0000
                -0.1000
                            0.1000
 F | 0.1379 | -0.0862 |
                          -0.0517
Оптимальное решение найдено!
x4 = x3 = 0, x1 = 0.138, x2 = 0.000
Целевая функция: F = 0.138
В результате получена оптимальная стратегия: (\alpha_2, 1 - \alpha_2) = [0, 1]
      x^2 = [0.583 0.
                         0.417]
      c^2 = [7.251 \ 8.917 \ 7.251]
      v^2 = 7.251
      J^2 = [1, 3]
Итерация 3:
Рассмотрим подыгру Г^3:
[[ 1. 11.]
[ 7. 8.]
 [16.
       2.]]
        Si0
                    х4
                                         х5
                              x1
                                      0.0614 I
  x3 | 0.0088 | -0.0702 | -0.6053 |
                            1.5263
                                     -0.1404
  x2 |
       0.1228
                 0.0175
  F
     | 0.1316 | -0.0526 | -0.0789
                                     -0.0789
Оптимальное решение найдено!
x4 = x1 = x5 = 0, x3 = 0.009, x2 = 0.123
Целевая функция: F = 0.132
Оптимальная стратегия игрока:
      -x_3 = [0.
                    0.933 0.067]
       ^{-}c 3 = [7.6]
                     5.067 7.6
Находим оптимальную стратегию игрока в подыгре из двух строк:
[[7.251 8.917 7.251]
 [7.6
       5.067 7.6 ]]
Удаление NBR-стратегий ['b3']
Матрица после уменьшения размерности:
[[7.251 8.917]
 [7.6 5.067]]
```

```
Si0
                    х3
                              x4
 x2 | 0.0537 | -0.2873
                            0.2336
 x1 | 0.0816
                 0.1633
                           -0.2449
     0.1353
                -0.1241
                           -0.0113
Оптимальное решение найдено!
x3 = x4 = 0, x2 = 0.054, x1 = 0.082
Целевая функция: F = 0.135
В результате получена оптимальная стратегия: (\alpha_3, 1 - \alpha_3) = [0.397 \ 0.603]
      x^3 = [0.352 \ 0.37 \ 0.278]
      c^3 = [7.389 \ 7.389 \ 7.389]
      v^3 = 7.389
      J^3 = [1, 2, 3]
Так как в Ј^З попали все номера столбцов, останавливаем алгоритм
Решение игры относительно игрока В
Итерация 0:
      x^0 = [1 \ 0 \ 0]
      c^0 = [1. 7. 16.]
      v^0 = 1.0
      J^{0} = [1]
<u>Итерация 1:</u>
Рассмотрим подыгру Г^1:
[[ 1.]
 [11.]
 [11.]]
Седловая точка найдена: (11.0, [0, 1, 0])
Оптимальная стратегия игрока:
      x_1 = [0 \ 1 \ 0]
       _c_1 = [11.    5.    6.]
Находим оптимальную стратегию игрока в подыгре из двух строк:
[[ 1.
      7. 16.]
 [11.
      5. 6.]]
Удаление NBR-стратегий ['b3']
Матрица после уменьшения размерности:
[[ 1.
       7.]
 [11.
       5.]]
        Si0
                    х3
                              x4
  x2 | 0.0833 |
                -0.0972
                            0.0139
  x1 | 0.0833 |
                 0.0694
                           -0.1528
l F
     | 0.1667 | -0.0278
                           -0.1389
Оптимальное решение найдено!
x3 = x4 = 0, x2 = 0.083, x1 = 0.083
Целевая функция: F = 0.167
В результате получена оптимальная стратегия: (\alpha_1, 1 - \alpha_1) = [0.5 \ 0.5]
      x^1 = [0.5 \ 0.5 \ 0.]
      c^1 = [6. 6. 11.]
      v^1 = 6.0
      J^1 = [1, 2]
<u>Итерация 2:</u>
Рассмотрим подыгру Г^2:
[[ 1. 7.]
 [11. 5.]
 [11. 8.]]
Седловая точка найдена: (8.0, [0, 0, 1])
Оптимальная стратегия игрока:
       x_2 = [0 \ 0 \ 1]
      c_2 = [11. 8. 2.]
Находим оптимальную стратегию игрока в подыгре из двух строк:
[[ 6. 6. 11.]
```

```
[11.
       8.
           2.]]
Удаление NBR-стратегий ['b2']
Матрица после уменьшения размерности:
[[ 6. 11.]
 [11. 2.]]
        Si0
                    х3
                              x4
  x2 |
       0.0459 I
                -0.1009
                            0.0550
                  0.0183
 x1 |
       0.0826
                           -0.1009
| F | 0.1284 |
                -0.0826
                           -0.0459
Оптимальное решение найдено!
x3 = x4 = 0, x2 = 0.046, x1 = 0.083
Целевая функция: F = 0.128
В результате получена оптимальная стратегия: (\alpha_2, 1 - \alpha_2) = [0.357 \ 0.643]
      x^2 = [0.321 \ 0.321 \ 0.357]
      c^2 = [7.786 \ 6.714 \ 7.786]
      v^2 = 6.714
      J^2 = [2]
Итерация 3:
Рассмотрим подыгру Г^3:
[[7.]
 [5.]
 [8.]]
Седловая точка найдена: (8.0, [0, 0, 1])
Оптимальная стратегия игрока:
      _{x_3} = [0 \ 0 \ 1]
       c_3 = [11. 8. 2.]
Находим оптимальную стратегию игрока в подыгре из двух строк:
[[ 7.786 6.714 7.786]
 [11.
          8.
                 2. ]]
Удаление NBR-стратегий ['b1']
Матрица после уменьшения размерности:
[[6.714 7.786]
 [8.
        2.
        Si0
                    х3
                              x4
  x2 |
       0.0219
                 -0.1594
                            0.1374
       0.1228
                  0.0409
                           -0.1637
  x1 |
| F
     | 0.1447 | -0.1184
                           -0.0263
Оптимальное решение найдено!
x3 = x4 = 0,
x2 = 0.022, x1 = 0.123
Целевая функция: F = 0.145
В результате получена оптимальная стратегия: (\alpha_3, 1 - \alpha_3) = [0.152 \ 0.848]
      x^3 = [0.273 \ 0.273 \ 0.455]
      c^3 = [8.273 \ 6.909 \ 6.909]
      v^3 = 6.909
      J^3 = [2, 3]
Итерация 4:
Рассмотрим подыгру Г^4:
[[ 7. 16.]
 [ 5. 6.]
 [8. 2.]]
```

```
Si0
                    x4
                              x2
                                         x5
  x3 |
       0.0789
                 -0.1404
                            0.3333
                                       0.0614
  x1
       0.0526
                  0.0175
                            0.3333
                                      -0.0702
       0.1316
                 -0.1228
                           -0.3333
                                      -0.0088
Оптимальное решение найдено!
x4 = x2 = x5 = 0, x3 = 0.079, x1 = 0.053
Целевая функция: F = 0.132
Оптимальная стратегия игрока:
      _{x_4} = [0.4 \ 0. \ 0.6]
       c_4 = [7.
                  7.6 7.6]
Находим оптимальную стратегию игрока в подыгре из двух строк:
[[8.273 6.909 6.909]
 [7.
        7.6
               7.6 ]]
Удаление NBR-стратегий ['b3']
Матрица после уменьшения размерности:
[[8.273 6.909]
 [7.
        7.6 ]]
        Si0
                    x4
                              х3
                           -0.5238
  х1
     0.0414
                  0.4825
       0.0940
  x2 |
                 -0.5702
                            0.4762
       0.1353
                 -0.0877
                           -0.0476
Оптимальное решение найдено!
x4 = x3 = 0, x1 = 0.041, x2 = 0.094
Целевая функция: F = 0.135
В результате получена оптимальная стратегия: (\alpha_4, 1 - \alpha_4) = [0.694 \ 0.306]
      x^4 = [0.361 \ 0.083 \ 0.556]
      c^4 = [7.389 \ 7.389 \ 7.389]
      v^4 = 7.389
      J^4 = [1, 2, 3]
Так как в Ј^4 попали все номера столбцов, останавливаем алгоритм
Цена игры: 5 <= 7.389 <= 11
      Смешанные стратегии игрока А
                                                   Смешанные стратегии игрока В
         a1
                    a2
                               а3
                                                      b1
                                                                b2
                                                                           b3
       0.352
                  0.370
                            0.278
                                                    0.361
                                                              0.083
                                                                         0.556
```

То есть решение, полученное для матричной игры монотонным итеративным алгоритмом:

7.389; S_A : (0.352, 0.370, 0.278); S_B : (0.361, 0.083, 0.556).

Вывод

В данной работе была исследована антагонистическая игра двух лиц с нулевой суммой, а также монотонный итеративный метод её решения. Для решения задачи был реализован алгоритм на Python, с помощью которого было найдено следующее решение игры:

7.389;
$$S_A$$
: (0.352, 0.370, 0.278); S_B : (0.361, 0.083, 0.556),

что совпадает с решением (с заданной точностью), найденным для этой же матрицы аналитическим методом. Также можно сравнить его с решением Брауна-Робинсон из лабораторной работы 1:

7.403;
$$\widetilde{S}_A[239]$$
: (0.393, 0.356, 0.251); $\widetilde{S}_B[239]$: (0.356, 0.092, 0.552).

Преимущество данного численного метода заключается в строгой монотонной сходимости оценки для цены игры. Однако для этого требуется относительно бо́льшая вычислительная сложность, чем в методе Брауна-Робинсон за счёт решения подыгр меньшей, но не всегда малой размерностей.

ПРИЛОЖЕНИЕ А

Листинг исходного кода реализации алгоритма

monotonic algorythm.ipynb

```
#!/usr/bin/env python
# coding: utf-8
# # Рубежный контроль №1
# **"Монотонный итеративный алгоритм решения матричной игры"**
# **Выполнил: Александров А. Н., ИУ8-104**
#
# **Вариант: 1**
#
# ## Задание
# Пусть с помощью матрицы А задана матричная антагонистическая игра двух игроков. По данной матрице
необходимо найти решение игры для первого игрока (то есть, вектор оптимальных стратегий и цену игры),
используя монотонный итеративный алгоритм.
# Игра Г размера (3 х 3) задана матрицей:
#
#
   1
       | 11 | 11 |
#
  | 7 | 5 | 8
| 16 | 6 | 2
#
#
# In[55]:
import logging
import numpy as np
from game_theory.utils.matrix_games.monotonic.monotonic import Monotonic
from game_theory.utils.matrix_games.game_matrix import GameMatrix
from game_theory.utils.matrix_games.mixed_strategies import check_resulted_game_price,
get_resulted_mixed_strategies
logging.basicConfig(level=logging.INFO, format='%(message)s')
# In[56]:
# Входная матрица прямоугольной игры с нулевой суммой.
game_matrix = GameMatrix(
    matrix=np.array(
            [1, 11, 11],
[7, 5, 8],
[16, 6, 2],
        dtype=int,
game_matrix
# In[57]:
print(f"Нижняя цена игры: {game_matrix.lowest_game_price[1]}\n"
      f"Верхняя цена игры: {game_matrix.highest_game_price[1]}")
# In[58]:
reduced_game: GameMatrix = game_matrix.reduce_dimension(method='dominant_absorption')
reduced_game
# ### Монотонный итеративный алгоритм
# In[59]:
reduced_game
```

```
# In[60]:
monotonic_method = Monotonic(reduced_game)
# In[61]:
    (game_price_for_a, player_a_mixed_strategies),
(game_price_for_b, player_b_mixed_strategies),
) = monotonic_method.solve()
# In[62]:
# Смешанные стратегии игрока А и цена игры.
assert check_resulted_game_price(
    game_matrix=reduced_game,
    game_price_value=game_price_for_a,
mixed_strategies = get_resulted_mixed_strategies(
    player_labels=game_matrix.player_a_strategy_labels,
    labels_to_probability=dict(zip(
         reduced_game.player_a_strategy_labels,
list(player_a_mixed_strategies),
    player_name="A",
print(mixed_strategies)
# In[63]:
# Смешанные стратегии игрока В и цена игры.
assert check_resulted_game_price(
    game_matrix=reduced_game,
    game_price_value=game_price_for_b,
)
mixed_strategies = get_resulted_mixed_strategies(
    player_labels=game_matrix.player_b_strategy_labels,
    labels_to_probability=dict(zip(
         reduced_game.player_b_strategy_labels,
         list(player_b_mixed_strategies),
    player_name="B",
print(mixed_strategies)
```

monotonic.py

```
"""Монотонный итеративный алгоритм решения матричной игры (n x m)-игры с нулевой суммой."""
import logging
import random
import numpy as np
from numpy import ndarray
from game_theory.utils.matrix_games.game_matrix import GameMatrix
from game_theory.utils.matrix_games.types import IndexType, ValueType
_logger = logging.getLogger(__name__)
class Monotonic:
    """Класс инкапсулирует решение матричной игры монотонным итеративным методом."""
         _init__(self, game_matrix: GameMatrix):
        self.game: GameMatrix = game_matrix
        self.iteration_number: int = 0
        self.strategy_index: IndexType
        self.strategy_x: np.ndarray[float]
        self.scores_c: np.ndarray[ValueType]
        self.price_v: ValueType
        self.indicator_mask_j: np.ndarray[bool]
    def solve(self):
```

```
# Решение за игрока А.
         _logger.info("Решение игры относительно игрока А")
         price_a, strategy_a = self._base_solve(np.float16(self.game.matrix))
iterations_a_count = self.iteration_number
        # Решения за игрока B. _logger.info("Решение игры относительно игрока B")
         price_b, strategy_b = self._base_solve(np.float16(self.game.matrix.T))
         iterations_b_count = self.iteration_number
         _logger.info(f"Итераций игроков сделано {(iterations_a_count, iterations_b_count)}")
         return (price_a, strategy_a), (price_b, strategy_b)
    def _base_solve(self, matrix: np.ndarray[ValueType]):
         m, n = matrix.shape
         self.iteration number = 0
         _logger.info("<mark>Итерация 0:"</mark>)
         # Выбираем произвольную (x^0) чистую стратегию (выставляя 1 только в одну позицию).
         strategy_index: IndexType = random.randint(0, m - 1)
         self.strategy_x = np.array([0] * n)
         self.strategy_x[strategy_index] = 1
         # Выбираем вектор (с^0), соответствующий выбранной стратегии.
         self.scores_c: np.ndarray = matrix[strategy_index].copy()
         # Текушая цена игры.
         self.price_v = np.min(self.scores_c)
         # Вектор-индикатор, который показывает принадлежность к множеству.
         self.indicator_mask_j: np.ndarray[bool] = np.isclose(self.scores_c, self.price_v)
         self.__log_calculated_parameters()
         alpha_values = np.array((np.inf, np.inf))
         # Выполняем итерации без заданной точности, то есть пока lpha_{-}N не станет 0.
         while not np.allclose(alpha_values, [0, 1]):
             optimal\_strategy\_x\_, \ optimal\_scores\_c\_, \ alpha\_values = self.perform\_iteration(matrix)
             alpha, _ = alpha_values
if not np.isclose(alpha, 0):
                  self.strategy_x = (1 - alpha) * self.strategy_x + alpha * optimal_strategy_x_
                  self.scores_c = (1 - alpha) * self.scores_c + alpha * optimal_scores_c_
                  self.price_v = np.min(self.scores_c)
                  self.indicator_mask_j = np.isclose(self.scores_c, self.price_v)
                 self.__log_calculated_parameters()
                 # Если в J_i попали все столбцы, завершаем алгоритм. if np.all(self.indicator_mask_j):
                      _logger.info(
                           f"Так как в J^{self.iteration_number} попали все номера столбцов, "
                          f"останавливаем алгоритм"
                      return self.price_v, self.strategy_x.copy()
          logger.info(f"Получили a_{self.iteration_number} = {alpha:.0f}, поэтому останавливаем
алгоритм\overline{})
         return self.price_v, self.strategy_x.copy()
    def perform_iteration(self, matrix: np.ndarray[ValueType], accuracy=3) -> tuple[ndarray, ndarray,
ndarray]:
         self.iteration number += 1
         i = self.iteration_number
         _logger.info(f"\nИтерация {self.iteration_number}:")
        # Выбираем только столбцы, удовлетворяющие нашему индикатору.
sub_game_matrix_a = GameMatrix(matrix[:, self.indicator_mask_j].copy())
_logger.info(f"Рассмотрим подыгру Г^{i}: " f"\n{np.round(sub_game_matrix_a.matrix, accuracy)}")
         # Решаем подыгру и находим оптимальную стратегию х_
         _, optimal_strategy_x_ = sub_game_matrix_a.solve()
         optimal_scores_c_: np.ndarray = self.__reduce_sum(matrix, np.array(optimal_strategy_x_))
         _logger.info(
             f"Оптимальная стратегия игрока: "
              f'' \setminus x_{i} = {np.round(optimal_strategy_x_, accuracy)}"
             f"\n\t c_{i} = {np.round(optimal_scores_c_, accuracy)}
        # Находим оптимальную стратегию игрока в подыгре из двух строк.
         sub_game_gamma = GameMatrix(np.stack((self.scores_c, optimal_scores_c_)))
         _logger.info(
             f"Находим оптимальную стратегию игрока в подыгре из двух строк: "
             f"\n{np.round(sub_game_gamma.matrix, accuracy)}"
         sub_game_gamma = sub_game_gamma.reduce_dimension(method="nbr_drop")
         _logger.info(
              "Матрица после уменьшения размерности: "
             f"\n{np.round(sub_game_gamma.reduce_dimension().matrix, accuracy)}"
         )
           alpha_values = sub_game_gamma.solve()
         alpha_values = (alpha_values[1] if len(alpha_values) == 2 else 0, alpha_values[0])
         _logger.info(
             -
f"B результате получена оптимальная стратегия: "
             f''(\alpha_{i}), 1 - \alpha_{i}) = "
```