

Lyapunov Optimization: An Introduction

Hailiang Zhao*

hliangzhao97@gmail.com

2018 年 11 月 21 日

目录

1 About	1
2 A Brief Introduction	2
3 How It Works	2
3.1 Optimization Problems	2
3.2 Stochastic Optimization Problems	3
3.3 How to Construct Virtual Queues	4
3.4 How to Solve the Problem	5
3.4.1 Drift-plus-penalty Expression	5
3.4.2 Drift-plus-penalty Algorithm	6
4 Performance Analysis	6
4.1 Average Penalty Analysis	7
4.2 Average Queue Size Analysis	10
4.3 Trade-off by Tuning V	10
5 Conclusions	11

1 About

本文档从引入优化问题的标准定义开始, 循序渐进地介绍了如何将 Lyapunov optimization 技术运用到随机优化问题的求解中. 作为一个完美主义者, 写作本文档可费了不少心思, 为了清晰地给出每一个结论是如何得到的, 数学推导部分在我看来显得过于啰嗦了. 但我相信这样的付出是有意义的. 本文中每一个出现的符号、脚注, 加粗、颜色和斜体都有着各自不同的含义.

Wikipedia 关于 Lyapunov optimization 的词条能给我们一个整体的认知, 但细节上却存在诸多纰漏. 在此之前我本人反复阅读数十遍, 但依旧有许多细节问题没有搞清楚. 当倘若先暂停手头的工作直接去阅读 Micheal J. Neely 的著作 *Stochastic Network Optimization with Application to Communication and Queueing Systems*, 时间上太不划算, 这也绝不是我做研究的方式. 优秀的研究者应当在应用中搞懂新的概念和方法, 而不是先搞懂所有涉及的概念再去思考

*Currently Hailiang Zhao is a fourth year undergraduate in School of Computer Science and Technology, Wuhan University of Technology. His homepage: <http://hliangzhao.me>.

应用, 因为概念和方法是无穷无尽的. 后来深入研究了自己方向内数篇将 Lyapunov optimization 运用的炉火纯青的论文, 总算把各类问题都搞清楚了.

本文档的目标读者是想迅速将 Lyapunov optimization 技术投入到论文的写作中并能针对性地给出性能分析的人. 我原本打算在本文档最后提供数个 case studies 来加深读者的印象, 但当我写完 Lyapunov optimization 的理论分析后, 就不愿意浪费笔墨和时间做这件事了 😊. **因为只要读者认真搞懂了本文档全部内容, 这些 case studies 完全不是问题.** 读者可自行阅读这些 case studies 对应的论文:

1. Yuyi Mao 关于 LODCO algorithm 的论文: *Dynamic computation offloading for mobile-edge computing with energy harvesting devices*;
2. Xu Chen 团队关于 mobility at MEC 的论文: *Follow Me at the Edge: Mobility-Aware Dynamic Service Placement for Mobile Edge Computing*;
3. Yuyi Mao 关于 non-binary task 计算卸载的论文: *Stochastic Joint Radio and Computational Resource Management for Multi-User Mobile-Edge Computing Systems*.

这些论文均可直接在 ArXiv 上下载.

2 A Brief Introduction

Lyapunov Optimization 是指: 使用 Lyapunov function¹来优化控制一个动态的系统. 系统在某一个特定的时间节点的状态 (state) 可以使用一个**多维向量** (multi-dimentional vector) 来描述, 而 Lyapunov function 则是对这个多维向量所表达的状态的一个**非负的、标量的描述** (a nonnegative scalar measure), 我们常常采用 ‘所有状态在各自权重下的平方和’ 来实行这一点. Lyapunov function 被设计的初衷是: 如果系统的状态朝向一个不被期望的 (undesirable) 方向发展, 那么 Lyapunov function 的数值就会变大. 这样, 我们就可以通过将 Lyapunov function 沿着 x 轴的负方向逼近 0 使系统趋向于稳定.

3 How It Works

现在, 我们看看一个随机优化问题 (stochastic optimization problem) 如何使用 Lyapunov Optimization 来求解, i.e., (i) 为原始问题构造队列; (ii) 给出使用 Lyapunov 优化技术得到的解; (iii) 分析该解和原始问题的最优解之间的差距 (optimality gap).

3.1 Optimization Problems

在给出随机优化问题 (stochastic optimization problem) 的通用形式之前, 先给出**不包含随机事件的、简单的优化问题** (optimization problem) 的定义.

一个优化问题是: 在满足数个约束的条件下最小化某一个目标 (最大化某一个目标可以转化为最小化该目标和 -1 的乘积). 在数学上可以表达为

$$\mathcal{P}_1 : \quad \min_{\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n} f(\mathbf{x}) \quad (3.1)$$

$$s.t. \quad c_i(\mathbf{x}) \leq 0, i = 1, 2, \dots, k \quad (3.2)$$

$$h_j(\mathbf{x}) = 0, j = 1, 2, \dots, l. \quad (3.3)$$

¹后文将会循序渐进地给出 Lyapunov function 以及相关概念的定义.

对于这样的约束最优化问题, 常常可以借助**拉格朗日对偶性** (Lagrange duality) 将原始问题转换为对偶问题, 通过求解对偶问题得到原始问题的解, 这就是高等数学中所谓的‘拉格朗日乘子法’, 以后会专门写作一篇 monograph 来讲解该方法.

3.2 Stochastic Optimization Problems

随机优化问题和优化问题相比, 多了**随机性**. 随机优化问题所谓的‘随机’是指每个时间片内有随机事件产生, 面对这个随机事件我们能够采取的策略也要随机应变才行.

不妨将第 t 个 time slot 内产生的所有随机事件标记为 $\mathbf{w}(t) \triangleq [w_1(t), w_2(t), \dots, w_n(t)] \in \Omega^n$, 假设 $\forall i \in \{1, \dots, n\}, w_i(t)$ 对每个 time slot 而言满足独立同分布 (i.i.d.)², 其中 Ω^n 为随机事件集合. 系统³在每个时间片内采取的策略, i.e., 动作 (control actions) 记为 $\alpha(t) \triangleq [\alpha_1(t), \alpha_2(t), \dots, \alpha_m(t)] \in \mathcal{A}^m$, 其中 \mathcal{A}^m 为控制决策集合.

在第 t 个 time slot, 根据当前发生的各个随机事件 $\mathbf{w}(t)$, 系统采取的一系列的控制决策 $\alpha(t)$, 对于想要优化的目标函数 $p(t)$ 而言, 会按照**某个已知的方式** (如 latency 的计算方法) 生成对应的数值, i.e.,

$$p(t) = P(\mathbf{w}(t), \alpha(t)), \quad (3.4)$$

其中 $P(\cdot)$ 就是一个确定的函数. 除了优化目标, 系统中的一系列变量 $y_k(t)$ (如功率的开销, 网络中可用的结点数量, 带宽子信道的个数)⁴也会受到我们所采取的控制决策的影响, 同样地, 可以描述为

$$y_k(t) = Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha(t)), k \in \{1, \dots, K\}, \quad (3.5)$$

其中 $\forall k \in \{1, \dots, K\}, Y_k(\cdot)$ 均为确定函数.

除了随机性, 在随机优化问题中, 优化目标不再是简单的 $f(\mathbf{x})$, 而是原始目标函数在 time average 下的表现. 这是因为只有当我们把 time average 引入, 每个时间片下的表现才能都被纳入考虑中. 现在, 我们给出随机优化问题的标准形式.

一个随机优化问题是: 在一个时间被分片的时间域上最小化一个 time average 的目标函数, 该目标函数在每个时间片的取值受到随机事件和采取的控制策略的影响. 此外还需满足数个 time average 的约束条件, 这些约束条件在每个时间片的取值亦受到随机事件和采取的控制策略的影响. 在数学上可以表达为

$$\mathcal{P}_2 : \min_{\forall t, \alpha(t) \in \mathcal{A}^m} \lim_{T \rightarrow \infty} \frac{1}{T} \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[p(t)] \quad (3.6)$$

$$s.t. \lim_{T \rightarrow \infty} \frac{1}{T} \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[y_k(t)] \leq 0, k \in \{1, \dots, K\}. \quad (3.7)$$

其中 $p(t)$ 由(3.4)得到, $y_k(t)$ 由(3.5)得到.

简单起见, 上述定义没有考虑等式约束.

为什么(3.6)和(3.7)中会出现期望运算 (Expectation)? 这是因为问题中存在随机变量的函数. 我们将服从独立同分布的随机事件 $\mathbf{w}(t)$ 看成在第 t 个时间片内的随机变量 \mathbf{X}^n , 那么由(3.4)

²其实, ‘满足独立同分布’这一条件是对现实问题的简化处理, Micheal J. Neely 的书²中论证过 Lyapunov Optimization 同样适用于 non-i.i.d. 的场景, 但求解会复杂很多, 本文档所涉及的 drift-plus-penalty algorithm 是无法处理这种情形的.

³这里的系统只是一个抽象的描述.

⁴其实, 这些变量可以是**任意变量**, 完全依赖于我们想要解决的问题. 在 LODCO 算法中, 这个除了 latency 之外还被影响到了的变量即是移动设备的电量.

和(3.5)可知 $p(t)$ 和 $y_k(t)$ 是随机变量的函数值。我们知道期望是定义在随机变量 (或者随机变量的函数) 上的, 因此期望运算很自然地引入随机优化问题中。

现在, 我们已经形成了一个标准的随机优化问题, 接下来将会深入阐述如何为这个问题的约束条件构造队列。在构造虚拟队列之前, 请回忆一下上次的讨论。当时我谈到我们会为那些对优化目标产生影响的变量定义队列。这是显然的, 因为一个随机优化问题的约束条件会缩小可行解空间 (feasible solution space), 显然会影响到优化目标。

3.3 How to Construct Virtual Queues

为什么要为随机优化问题的约束条件定义队列? 这是因为我们希望把满足这些长期的约束条件所应当采取的操作分解到每一个时间片内进行。

毕竟, 操作 $\alpha(t)$ 是要落地到每一个时间片 t 内的。Lyapunov Optimization 的思想就是: 将具有长期约束条件的某个长期优化指标 (i.e., $\lim_{T \rightarrow \infty} \frac{1}{T} \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[p(t)]$) 分解到每一个时间片内进行。这样, 在每一个时间片 t 内, 我们就可以在不破坏当前这个时间片需要遵循的约定 (i.e., 控制队列保持稳定) 的情况下直接优化 $p(t)$ 。

因此, 对每一个约束条件 $y_k(t)$ 定义一个对应的、初始值为 0⁵的队列 $Q_k(t)$:

$$Q_k(t+1) = \max\{Q_k(t) + y_k(t), 0\}, k \in \{1, \dots, K\}. \quad (3.8)$$

其实 $Q_k(t)$ 并非队列 (the k th queue) 本身, 而是队列的储备量 (the k th queue's backlog)。队列只是一个概念, 而队列的储备量才是一个数值。我们先前提到的‘有进有出’作为增量出现在(3.8)中, 也就是 $y_k(t)$, 为什么我们之前总是希望‘出的’(能处理的) 尽可能大于‘进的’(新抵达的)? 这是因为约束条件中, 我们希望 time average of $y_k(t)$ 不大于 0。

现在, 我们研究一下如何控制队列 $Q_k(t)$ 来保证(3.7)恒成立。由(3.8)可知

$$Q_k(t+1) \geq Q_k(t) + y_k(t), k \in \{1, \dots, K\}^6. \quad (3.9)$$

变形可得 $y_k(t) \leq Q_k(t+1) - Q_k(t)$, 对所有时间片执行累加操作, 即可得

$$\sum_{t=0}^{T-1} y_k(t) \leq Q_k(T) - Q_k(0) = Q_k(T), k \in \{1, \dots, K\}. \quad (3.10)$$

两边同时取期望可得

$$\frac{1}{T} \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[y_k(t)] \leq \frac{\mathbb{E}[Q_k(T)]}{T}, k \in \{1, \dots, K\}. \quad (3.11)$$

这时想必大家会好奇期望这个运算为何如此来去自由。这是因为(3.8)-(3.10)只是中间的推导阶段, 不加上期望运算可以让整个过程简洁易懂。但是不含期望运算的(3.11)是没有意义的。

现在, 让我们观察一下(3.7)和(3.11)。为了让前者成立, 我们可以让

$$\lim_{T \rightarrow \infty} \frac{\mathbb{E}[Q_k(T)]}{T} = 0, k \in \{1, \dots, K\} \quad (3.12)$$

成立, 也可以让

$$\exists \delta \leq 0, \lim_{T \rightarrow \infty} \frac{\mathbb{E}[Q_k(T)]}{T} \leq \delta, k \in \{1, \dots, K\} \quad (3.13)$$

成立。(3.12)和(3.13)都可以让约束条件(3.7)恒成立, 但是显然后者是更为严格的稳定。在 Micheal J. Neely 的书中, (3.12)被称为中等程度的稳定 (mean rate stable)。

Lyapunov Optimization 常常采用(3.12)。在对稳定性更为苛刻的系统中, 显然(3.13)更适合。

有了队列的概念, 我们就可以形成新问题了。

⁵即 $\forall k \in \{1, \dots, K\}, Q_k(0) = 0$ 。

⁶这是因为 $\max\{a, b\} \geq a$ 且 $\max\{a, b\} \geq b$ 。

新的随机优化问题可定义成

$$\mathcal{P}_3 : \min_{\forall t, \alpha(t) \in \mathcal{A}^m} \lim_{T \rightarrow \infty} \frac{1}{T} \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[p(t)] \quad (3.14)$$

s.t. (3.12).

3.4 How to Solve the Problem

3.4.1 Drift-plus-penalty Expression

说了这么多, 终于轮到 Lyapunov 函数 (Lyapunov function) 登场了. 正如前文所述, Lyapunov function 是对当前时间片内所有 queues' backlog 的一个标量的、非负的描述. 将队列全体用一个矢量来描述: $\Theta(t) \triangleq [Q_1(t), \dots, Q_K(t)]$, 则 Lyapunov function 定义⁷为

$$L(\Theta(t)) \triangleq \frac{1}{2} \sum_{k=1}^K Q_k(t)^2. \quad (3.15)$$

有了 Lyapunov function, 我们可以用 $\Delta(\Theta(t)) \triangleq L(\Theta(t+1)) - L(\Theta(t))$ ⁸ 表示从时间片 t 到时间片 $(t+1)$ 全体 queues' backlog 的增长量, 称之为 *Lyapunov 漂移* (Lyapunov drift).

由(3.9)可知

$$Q_k(t+1)^2 \leq (Q_k(t) + y_k(t))^2, k \in \{1, \dots, K\}. \quad (3.16)$$

为什么(3.16)成立? 接下来给出证明.

分类讨论. (i) 若 $Q_k(t) + y_k(t) \geq 0$, 则 $Q_k(t+1) = Q_k(t) + y_k(t)$, 因此

$$Q_k(t+1)^2 = (Q_k(t) + y_k(t))^2, k \in \{1, \dots, K\}. \quad (3.17)$$

(ii) 若 $Q_k(t) + y_k(t) < 0$, 则 $Q_k(t+1) = 0 > Q_k(t) + y_k(t)$, 因此

$$Q_k(t+1)^2 = 0 < (Q_k(t) + y_k(t))^2, k \in \{1, \dots, K\}. \quad (3.18)$$

结合(3.17)和(3.18), 可知(3.16)成立. 虽然直观上会觉得(3.16)和(3.9)相悖.

在(3.16)的基础上对所有 K 个队列累加, 可得

$$\frac{1}{2} \sum_{k=1}^K Q_k(t+1)^2 \leq \frac{1}{2} \sum_{k=1}^K Q_k(t)^2 + \frac{1}{2} \sum_{k=1}^K y_k(t)^2 + \sum_{k=1}^K Q_k(t)y_k(t), \quad (3.19)$$

因此有

$$\begin{aligned} \Delta(\Theta(t)) &= \frac{1}{2} \sum_{k=1}^K Q_k(t+1)^2 - \frac{1}{2} \sum_{k=1}^K Q_k(t)^2 \\ &\leq \frac{1}{2} \sum_{k=1}^K y_k(t)^2 + \sum_{k=1}^K Q_k(t)y_k(t) \leq B + \sum_{k=1}^K Q_k(t)y_k(t), \end{aligned} \quad (3.20)$$

其中 B 是一个常数. 为什么 $\frac{1}{2} \sum_{k=1}^K y_k(t)^2$ 一定存在一个正常数上界? 观察(3.5), 其实可以找到反例⁹. 虽然在绝大多数实际问题中这一点都能得以满足, 但只要存在反例就不应该这样描述. 因此, 对于这一点我们先留个疑问 \triangle .

⁷仔细阅读 Micheal J. Neely 的书, 会发现 Lyapunov 函数的严格定义为 $L(\Theta(t)) \triangleq \frac{1}{2} \sum_{k=1}^K w_k Q_k(t)^2$, $\{w_k\}_{k=1}^K$ 为各个队列的权重.

⁸ $\Delta(\Theta(t))$ 的标准定义是: $\Delta(\Theta(t)) \triangleq \mathbb{E}[L(\Theta(t+1)) - L(\Theta(t)) | \Theta(t)]$. 此处从简处理.

⁹例如对于某个来自 random event set 的 \mathbf{w} 和某个来自 random action set 的 α , $Y_k(\mathbf{w}, \alpha) \rightarrow -\infty$.

3.4.2 Drift-plus-penalty Algorithm

先前我们说过, 引入队列之后就可以在不破坏当前这个时间片需要遵循的约定 (控制队列保持稳定) 的情况下直接优化 $p(t)$, 那么, 如何实现对相关约定的遵循呢? 一个很直观的方式就是在每一个时间片内求解 $\Delta(\Theta(t)) + V \cdot p(t)$ 的最小值, 也就是同时求解 Lyapunov 漂移和 $p(t)$ 的最小值, 借助权重 V 来调节对二者的重视程度. 因此我们可以形成问题 \mathcal{P}_4 :

$$\begin{aligned} \mathcal{P}_4 : \quad & \min_{\forall t, \alpha(t) \in \mathcal{A}^m} \mathbb{E}[\Delta(\Theta(t)) + V \cdot p(t) | \Theta(t)] \\ & \text{s.t.} \quad (3.12). \end{aligned} \quad (3.21)$$

接下来我们会看到 drift-plus-penalty algorithm 就是通过求解 \mathcal{P}_4 的近似最优解来求解 \mathcal{P}_3 的.

可是, 在时间片 t 内怎么去求解 $\Delta(\Theta(t)) + V \cdot p(t)$ 的最小值呢? 这个优化目标中, 只有获得 $L(\Theta(t+1))$ 才能表示出 $\Delta(\Theta(t))$, 这意味着我们需要下一个时间片的信息, 这样我们就无法在当前这个时间片内解决这个问题了. 仔细观察(3.20), 如果我们对 $\Delta(\Theta(t)) + V \cdot p(t)$ 做一些放缩处理, i.e.,

$$\Delta(\Theta(t)) + V \cdot p(t) \leq B + V \cdot p(t) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) y_k(t), \quad (3.22)$$

然后求解(3.22)的右端的最小值, 这样问题就得以解决. 代价是我们求解的并非原始问题的最优解¹⁰. 因此, 我们形成问题 \mathcal{P}_5 :

$$\begin{aligned} \mathcal{P}_5 : \quad & \min_{\forall t, \alpha(t) \in \mathcal{A}^m} \mathbb{E}[B + V \cdot p(t) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) y_k(t) | \Theta(t)] \\ & \text{s.t.} \quad (3.12). \end{aligned} \quad (3.23)$$

现在终于可以引入传说中的 drift-plus-penalty algorithm 了. 请仔细观察该算法. 可以发现该算法求解的其实是去掉了约束条件(3.12)的 \mathcal{P}_5 . 其实从引入 Lyapunov 漂移 $\Delta(\Theta(t))$ 开始, 也就是对问题 \mathcal{P}_4 和 \mathcal{P}_5 , 对约束(3.12)的处理就已经被浓缩进最小化 $\Delta(\Theta(t))$ 中了. 至于为什么能够这样做, 这是讨论时杜老师提出的问题, 现在我可以解答了 😊. 其实这个问题是在质疑 drift-plus-penalty 算法的合理性, 想要回答这个问题也很简单, 我们只需证明 drift-plus-penalty 算法取得的解能够让(3.12)恒成立即可 △. 对这个问题的解答会放到 §4.1.

至此, Lyapunov 优化的核心部分已经讲解完毕. 可以发现, drift-plus-penalty 算法的确将一个从长期角度来衡量的随机优化问题的求解具体到了每一个时间片内. 除此之外, 该算法不仅不需要来自未来的系统状态信息, 甚至也不需要知道随机事件 $\mathbf{w}(t)$ 的概率分布! 这意味该算法几乎不需要对环境有任何认知, 在强化学习领域, 这样的算法被称为免模型学习 (model-free learning).

4 Performance Analysis

所谓的性能分析 (performance analysis) 分析的是 drift-plus-penalty 算法取得的解和原始问题 \mathcal{P}_2 的最优解之间的差距 (optimality gap). 要执行性能分析, 首先要描述出 \mathcal{P}_2 的最优解. 接下来

¹⁰关于这一点有必要作一说明. 其实一旦使用了 Lyapunov 优化, 一定求不到原始问题最优解, 因为此处作了放缩处理. 但是对于新问题——求解 $B + V \cdot p(t) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) y_k(t)$ 的最小值而言, 最优解是可以取得的.

Algorithm 1 Drift-plus-penalty algorithm

- 1: 在时间片 t 的开头, 观察发生的所有随机事件以及所有队列的储备量: $\mathbf{w}(t), \Theta(t)$.
- 2: 通过求解如下问题确定最优的控制决策 $\alpha^*(t)$:

$$\alpha^*(t) = \underset{\alpha(t) \in \mathcal{A}^m}{\operatorname{argmin}} \mathbb{E}[B + V \cdot p(t) + \sum_{k=1}^K Q_k(t)y_k(t)|\Theta(t)]. \quad (3.24)$$

- 3: $\forall k \in \{1, \dots, K\}$, 根据(3.8)更新 $Q_k(t)$.
 - 4: $t \leftarrow t + 1$.
-

分别从目标函数和队列稳定程度两个角度深入分析 optimality gap.

4.1 Average Penalty Analysis

首先定义 \mathcal{P}_2 的 **w-only** 策略 (*w-only policy*).

w-only policy. 这个策略 (which is stationary and random) 在每个时间片 t 内仅仅依赖于观测到的 $\mathbf{w}(t)$ 来选择最优控制动作 $\alpha^\dagger(t)$. i.e., 对于每一个可能的随机事件 $\mathbf{w}(t) \in \Omega^n$, **w-only policy** 依据一个条件概率分布选取 $\alpha^\dagger(t)$:

$$\alpha^\dagger(t) = \underset{\alpha(t) \in \mathcal{A}^m}{\operatorname{argmax}} \Pr(\alpha(t)|\mathbf{w}(t)). \quad (4.1)$$

由此可见, **w-only policy** 是一个并不依赖于队列状态 (queues' backlog) 的策略¹¹.

接下来给出最优 **w-only** 策略 (*optimal w-only policy*) 的定义.

最优 **w-only** 策略是满足如下条件的一个 **w-only** 策略——在每个时间片内, 最优 **w-only** 策略采取的动作 $\alpha^*(t)$ 满足:

$$P(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)) = p^*, \quad (4.2)$$

$$Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)) \leq 0, k \in \{1, \dots, K\}, \quad (4.3)$$

其中 p^* 是 \mathcal{P}_2 的最优目标函数值, i.e.,

$$p^* = \min \left(\lim_{T \rightarrow \infty} \frac{1}{T} \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[p(t)] \right). \quad (4.4)$$

请注意 $\alpha^\dagger(t)$ 和 $\alpha^*(t)$ 的区别.

假设问题 \mathcal{P}_2 是存在最优 w-only 策略的. 这是一个至关重要的假设, 它至少¹²意味着原始问题 \mathcal{P}_2 是有最优解的. 如果没有最优解, 那么 optimality gap 也无从说起. 但就算有最优解, 倘若不知道这个最优解是如何构造出来的, 我们还是无法做 optimality gap 的分析. 而最优 **w-only** 策略正是提供了最优解的一种构造方法. 实际上, Micheal J. Neely 在书中论证过: 如果原始问题 \mathcal{P}_2 有解, 那么 \mathcal{P}_2 一定存在最优 **w-only** 策略. 如无特别强调, 接下来的 $\alpha(t)$ 表示在每个时间片 t 执行 drift-plus-penalty algorithm 得到的策略, $\Delta(\Theta(t))$ 和 $p(t)$ 分别表示执行 drift-plus-penalty 算法得到的 Lyapunov drift 和 penalty.

¹¹这是显然的, 因为原始问题 \mathcal{P}_2 中根本没有队列的概念.

¹²请体会此处‘至少’的含义.

现在开始分析 optimality gap. 由(3.22)和(3.24)可得

$$\begin{aligned}
\Delta(\Theta(t)) + V \cdot p(t) &\leq B + V \cdot p(t) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) y_k(t) \\
&= B + V \cdot P(\mathbf{w}(t), \alpha(t)) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha(t)) \\
&\leq B + V \cdot P(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)). \tag{4.5}
\end{aligned}$$

对(4.5)两边同时取期望¹³, 得

$$\begin{aligned}
&\mathbb{E}[\Delta(\Theta(t)) + V \cdot p(t) | \Theta(t)] \\
&\leq \mathbb{E}[B + V \cdot P(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)) | \Theta(t)] \tag{4.6}
\end{aligned}$$

$$= B + V \cdot \mathbb{E}[P(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)) | \Theta(t)] + \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(t) Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)) | \Theta(t)] \tag{4.7}$$

$$= B + V \cdot \mathbb{E}[P(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t))] + \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(t) Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)) | \Theta(t)] \tag{4.8}$$

$$= B + V \cdot \mathbb{E}[P(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t))] + \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(t) | \Theta(t)] \mathbb{E}[Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t)) | \Theta(t)] \tag{4.9}$$

$$= B + V \cdot \mathbb{E}[P(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t))] + \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(t) | \Theta(t)] \mathbb{E}[Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t))] \tag{4.10}$$

$$\leq B + V \cdot p^*. \tag{4.11}$$

上述推导中, 从(4.6)到(4.7)是因为期望的运算规则; 从(4.7)到(4.8)是因为最优 \mathbf{w} -only 策略不依赖于队列状态 $\Theta(t)$, 因而 $P(\cdot)$ 与 $\Theta(t)$ 无关; 从(4.8)到(4.9)是因为 $Q_k(t)$ 和 $Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^*(t))$ 相互独立¹⁴, 因为最优 \mathbf{w} -only 策略与队列 $Q_k(t)$ 无关; 从(4.9)到(4.10)是因为最优 \mathbf{w} -only 策略得到的 $Q_k(\cdot)$ 与队列状态 $\Theta(t)$ 无关; 从(4.10)到(4.11)是因为(4.3).

将上述推导结论对时间片进行累加, 得到

$$(B + V \cdot p^*)T \geq \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[\Delta(\Theta(t)) + V \cdot p(t) | \Theta(t)] \tag{4.12}$$

$$= \mathbb{E}[L(\Theta(T)) - L(\Theta(0))] + V \cdot \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[p(t) | \Theta(t)] \tag{4.13}$$

$$= \mathbb{E}[L(\Theta(T))] + V \cdot \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[p(t) | \Theta(t)] \tag{4.14}$$

$$\geq V \cdot \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[p(t) | \Theta(t)] \tag{4.15}$$

从(4.14)到(4.15)是因为 $L(\Theta(T)) \geq 0$. 因此我们可以得到最终结论:

$$\frac{1}{T} \sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[p(t) | \Theta(t)] \leq p^* + \frac{B}{V}. \tag{4.16}$$

¹³注意 $\Delta(\Theta(t))$ 的严格定义 (在脚注 8 给出), 因为本身就携带了条件期望, 因此 $\mathbb{E}[\Delta(\Theta(t)) | \Theta(t)] = \mathbb{E}[\Delta(\Theta(t))]$.

¹⁴能否去掉条件期望中的条件, 要看期望本身是否与条件相互独立.

这个结论意味着什么呢？这意味着只要将 V 设置的足够大, 通过执行 drift-plus-penalty 算法得到的解可以无限逼近 \mathcal{P}_2 的最优解 p^* . 那么我们常看到的 $O(\frac{1}{V})$ 又是什么意思呢？我们先来回顾一下《算法导论》中对于符号 O 的定义:

对于给定的函数 $g(x)$, 用 $O(g(x))$ 表示以下函数的集合:

$$O(g(x)) \triangleq \{f(x) | \exists c, x_0 \in \mathbb{R}^+, \forall x \geq x_0, 0 \leq f(x) \leq cg(x)\}. \quad (4.17)$$

观察(4.16)的右端, 只有一个变量 (可调节参数) V , 其余均为定值 (常数). 因此, 对于(4.16), $g(V) = p^* + \frac{B}{V}$, $\sum_{t=0}^{T-1} \mathbb{E}[p(t)|\Theta(t)]$ 就可以用 $O(g(V)) = O(p^* + \frac{B}{V}) = O(\frac{1}{V})$ 来描述.

接下来我们证明为什么执行 drift-plus-penalty 算法得到的解能够让约束条件(3.12)恒成立. 假设¹⁵存在一个w-only 策略 $\alpha^\bullet(t)$ (不强求是最优 w-only 策略)) 满足

$$\exists \epsilon > 0, \mathbb{E}[Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^\bullet(t))] \leq -\epsilon, k \in \{1, \dots, K\}. \quad (4.18)$$

此外, 我们还需要假设 $P(\cdot)$ 是有界函数, i.e.,

$$\exists p_{min}, p_{max} \in \mathbb{R}, \forall \mathbf{w} \in \Omega^n, \alpha \in \mathcal{A}^m, p_{min} \leq P(\mathbf{w}, \alpha) \leq p_{max}. \quad (4.19)$$

类似(4.5), 结合(3.22)与(3.24), 我们可以得到

$$\begin{aligned} \Delta(\Theta(t)) + V \cdot p(t) &\leq B + V \cdot p(t) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) y_k(t) \\ &= B + V \cdot P(\mathbf{w}(t), \alpha(t)) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha(t)) \\ &\leq B + V \cdot P(\mathbf{w}(t), \alpha^\bullet(t)) + \sum_{k=1}^K Q_k(t) Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^\bullet(t)). \end{aligned} \quad (4.20)$$

因此

$$\Delta(\Theta(t)) + V \cdot p_{min} \leq B + V \cdot p_{max} + \sum_{k=1}^K Q_k(t) Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^\bullet(t)). \quad (4.21)$$

对(4.21)两边同时取期望, 得到

$$\begin{aligned} &\mathbb{E}[\Delta(\Theta(t)) | \Theta(t)] + V \cdot p_{min} \\ &\leq B + V \cdot p_{max} + \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(t) | \Theta(t)] \mathbb{E}[Y_k(\mathbf{w}(t), \alpha^\bullet(t))] \end{aligned} \quad (4.22)$$

$$\leq B + V \cdot p_{max} - \epsilon \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(t) | \Theta(t)] \quad (4.23)$$

所以可得

$$\mathbb{E}[L(\Theta(t+1))] - \mathbb{E}[L(\Theta(t))] \leq B' - \epsilon \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(t) | \Theta(t)], \quad (4.24)$$

¹⁵用棕色标示出的是假设, 他们是论证成立的前提. 在大多数实际问题中, 这些假设基本都能成立. 实际上我们在 §3.4.1 提出的疑问也是假设.

其中 $B' \triangleq B + V(p_{\max} - p_{\min})$. 对所有时间片累加(4.24), 可得

$$\mathbb{E}[L(\Theta(T))] - \mathbb{E}[L(\Theta(0))] \leq B' \cdot T - \epsilon \sum_{t=0}^{T-1} \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(t)|\Theta(t)], \quad (4.25)$$

根据(3.8)可知 $Q_k(t) \geq 0$, 因此对于(4.25), 可以放缩得到

$$\mathbb{E}[L(\Theta(T))] - \mathbb{E}[L(\Theta(0))] \leq B' \cdot T. \quad (4.26)$$

将 Lyapunov function 的定义(3.15)带入上式可得

$$\frac{1}{2} \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(T)^2] \leq 0 + B' \cdot T. \quad (4.27)$$

由柯西不等式 $(\sum_{i=1}^n x_i y_i)^2 \leq (\sum_{i=1}^n x_i^2)(\sum_{i=1}^n y_i^2)$, 继续推导上式可得

$$\left(\sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(T)]\right)^2 \leq K \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(T)^2] \leq 2KB' \cdot T. \quad (4.28)$$

我们已经十分接近结论了. 对上式两边开方并取极限得

$$\lim_{T \rightarrow \infty} \frac{\sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(T)]}{T} \leq \lim_{T \rightarrow \infty} \sqrt{\frac{2KB'}{T}} = 0. \quad (4.29)$$

再次运用结论 $Q_k(t) \geq 0$, 我们就成功解答了在 §3.4.1 提出的疑问——**所有队列都是 mean rate stable**:

$$\forall k \in \{1, \dots, K\}, \lim_{T \rightarrow \infty} \frac{\mathbb{E}[Q_k(T)]}{T} = 0. \quad (4.30)$$

这意味 drift-plus-penalty 的确能够求解原始问题 \mathcal{P}_2 .

4.2 Average Queue Size Analysis

本节分析执行 drift-plus-penalty 算法取得的 queues' backlog **收敛到一个非正数的速度**.

对于 §4.1 推导得到的中间结论(4.25), 变形可得

$$\frac{1}{T} \sum_{t=0}^{T-1} \sum_{k=1}^K \mathbb{E}[Q_k(t)|\Theta(t)] \leq \frac{B'}{\epsilon} + \mathbb{E}[L(\Theta(0))] - \mathbb{E}[L(\Theta(T))] \leq \frac{B + V(p_{\max} - p_{\min})}{\epsilon}. \quad (4.31)$$

上述过程运用了结论 $\mathbb{E}[L(\Theta(T))] \geq 0, \mathbb{E}[L(\Theta(0))] = 0$.

现在我们已经得到了最终结论. 仔细观察(4.31), 它意味着什么呢? 同样地, 请回忆(4.17)对符号 O 的定义和 $O(\frac{1}{V})$ 结论的分析过程. 这里 V 作为唯一可变参数决定了 queues' backlog 的大小, 它决定了原始问题 \mathcal{P}_2 的时均约束(3.7)收敛到一个非负数的速度. 因此时均队列大小 (time average queue size) 可以用 $O(V)$ 来衡量.

4.3 Trade-off by Tuning V

在 §4.1 和 §4.2 我们分别证明了 time average penalty(optimization goal) 和 time average queue size(optimization constraints) 分别是 $O(\frac{1}{V})$ 和 $O(V)$ 的. 显然, 参数 V 对于这两者有着完全相反的影响. 因此我们必须做出以下 trade-off:

1. 获得更加逼近于原始问题 \mathcal{P}_2 最优解 p^* 的解, 但需要一个更长的时间域才能让时均约束得以满足;

2. 在尽可能短的时间域内使时均约束得以满足, 但会牺牲目标函数值的优越性 (只能取得一个相对较差的解).

实际上, 这就是算法执行时间 (迭代次数) 和算法效率 (解的精度) 之间的 trade-off. 因为我们考虑的实际问题中不可能存在 $T \rightarrow \infty$ 的系统, 因此算法的精度总会打一个折扣. 就这是为什么 drift-plus-penalty algorithm 常常被批评 ‘只能取得近似最优解’ 的原因. 关于这个问题, 我已经在前文的脚注 10 中注明.

5 Conclusions

本文档给出 drift-plus-penalty 算法和理论分析后就不再续笔. 因为全文是针对一个普适的随机优化问题 \mathcal{P}_2 来分析的, 因此全部推导过程均具备普适性, 读者只需带入自己模型所定义问题即可.

虽然说从头到尾阅读 Micheal J. Neely 的书不现实, 但实际上我还是做了一些参考的工作的 ☺. 如果我们认真阅读此书, 会发现书中有着严格得多的定义和详实的论证. Prof. Neely 在本文档所阐述的基本模型的基础上, 又讨论了 Lyapunov optimization(i) 在存在真实队列的系统中的运用 (而非从约束条件构造出来的虚拟队列); (ii) 在随机凸优化问题中的具体实现; (iii) 在不满足 i.i.d. 的随机事件的随机优化问题中的运用; (iv) 在可变长时间片的时域系统中的运用; (v) 在凸规划 (convex programming) 问题中的具体实现; (vi) 在线性规划问题中的具体实现; ...

对于一类比较特殊的问题——系统中存在**不收敛到非正数**且真实存在的队列, 我在后续的工作中会专门写一篇 monograph 来分析.