Homework 1

Giulio Nenna (s292399@studenti.polito.it)

January 5, 2022

Realizzato in collaborazione con Alessandro Bonaduce (s289906@studenti.polito.it), Davide Grande (s292174@studenti.polito.it).

Esercizio 1.

(a) Date le seguenti funzioni di utilità per ciascun giocatore:

$$u_i(x) = -\frac{x_i^2}{2} + c_i x_i + \beta \sum_{j \neq i} W_{ij} x_j x_i$$

trovare le funzioni di *Best Response* per ciascun giocatore significa trovare le seguenti:

$$BR_i(x_{-i}) = \arg\max_{x_i \in \mathcal{A}} u_i(x_i, x_{-i}).$$

Poiché $u_i(x)$ è concava rispetto a x_i, trovare punti stazionari rispetto a x_i significa trovare massimi globali:

$$\frac{\delta u_i(x)}{\delta x_i} = -x_i + c_i + \beta \sum_{j \neq i} W_{ij} x_j$$

$$\frac{\delta u_i(x)}{\delta x_i} = 0 \qquad \iff \qquad x_i = c_i + \beta \sum_{j \neq i} W_{ij} x_j.$$

Pertanto:

$$BR_i(x_{-i}) = c_i + \beta \sum_{j \neq i} W_{ij} x_j.$$

(b) Poichè il grafo è privo di self-loop, la matrice di adiacenza W non presenta elementi non nulli sulla diagonale. è pertanto possibile utilizzare la seguente espressione per gli equilibri di Nash:

$$x^* = \beta W x^* + c. \tag{1}$$

Quindi, in forma esplicita, abbiamo:

$$x^* = (I - \beta W)^{-1}c.$$

Questo significa che esistenza ed unicità di eventuali equilibri di Nash dipendono dalla singolarità della matrice $(I - \beta W)$: se l'inversa della matrice $(I - \beta W)$ esiste ed è unica, allora esiste ed è unico l'equilibrio di Nash x^* associato .

DA INDAGARE SE ESISTONO CASI IN CUI L'EQUILIBRIO NON è UNICO

La condizione:

$$\beta\omega_i < 1 \qquad \forall i \in \mathcal{V} \tag{2}$$

impone che le righe della matrice βW sommino ad una quantità strettamente minore di 1. La matrice βW si dice pertanto essere *substocastica* e il suo raggio spettrale soddisfa la condizione $\rho(\beta W) < 1$. Può quindi essere applicato il *Criterio di Neumann* che ci assicura esistenza ed unicità della matrice $(I - \beta W)^{-1}$. In particolare vale:

$$(I - \beta W)^{-1} = \sum_{k=0}^{\infty} \beta^k W^k \tag{3}$$

(c) Come visto per il punto precedente, se esiste ed è unico, l'equilibrio di Nash del gioco è dato da:

$$x^* = (I - \beta W)^{-1}c$$

pertanto è nella forma $x^* = Mc$ e dipende linearmente dal vettore c. Nel caso in cui valga 2 allora, per il *criterio di Neumann* abbiamo:

$$M = \sum_{k=0}^{\infty} \beta^k W^k. \tag{4}$$

Inoltre vale:

$$(W^k)_{ij} = \text{ \# di path da i a j di lunghezza k} \implies (W^k)_{ij} \geq 0 \quad \forall i, j \in \mathcal{V}$$

Pertanto M è dato dalla somma di matrici con elementi tutti non negativi:

$$M_{ij} \geq 0 \qquad \forall i, j \in \mathcal{V}$$

(d) Il vettore di centralità di Katz del grafo è dato da:

$$z = \left(I - \left(\frac{1-\beta_K}{\lambda_W}\right) W'\right)^{-1} \beta_K \mu$$

Abbiamo quindi il seguente risultato:

$$z'c = \left(\left(I - \frac{1-\beta_K}{\lambda_W} W'\right)^{-1} \beta_K \mu\right)' c = \beta_k \mu' \left(I - \frac{1-\beta_K}{\lambda_W} W\right)^{-1} c$$

Ponendo quindi [1]

$$\frac{1-\beta_K}{\lambda_W} = \beta \iff \beta_K = 1 - \lambda_W \beta$$

e

$$\mu = \frac{1}{1-\lambda_W \beta} \mathbb{1}$$

si ottiene un vettore di centralità di Katz:

$$\hat{z} = \left(I - \beta W'\right)^{-1} \mathbb{1} \tag{5}$$

tale per cui:

$$\hat{z}'c = \mathbb{1}'(I - \beta W)^{-1} c = \sum_{j \in \mathbb{V}} x_j^* = y. \tag{6}$$

(e) Vale il seguente risultato:

$$Var(y) = Var(\hat{z}'c) = \hat{z}' VarCov(c) \hat{z}$$

Essendo il vettore c un vettore di variabili aleatorie indipendenti:

$$Varcov(c) = \begin{bmatrix} \sigma_1^2 & & 0 \\ & \ddots & \\ 0 & & \sigma_n^2 \end{bmatrix}$$

Pertanto vale:

$$Var(y) = \sum_{i=1}^{n} \hat{z}_i^2 \sigma_i^2 = \sum_{i=1}^{n} ((I - \beta W')^{-1} \mathbb{1})_i^2 \sigma_i^2$$

[1] L'operazione è lecita dal momento che la matrice βW è substocastica. Questo vuol dire che $\rho(\beta W) = \beta \rho(W) < 1$, pertanto $\beta_K \in [0, 1]$.

(f) Sia i_K il key player del gioco e sia $W^{(-i_K)}$ la matrice di adiacenza del grafo $\mathcal{G}^{(-i_K)}$ privato del nodo i_K. Poiché la funzione di utility di ciascun nodo rimane invariata nella forma, si possono applicare gli stessi ragionamenti dei punti precedenti per trovare che esiste ed è unico l'equilibrio di Nash:

$$x^{*(-i_K)} = (I - \beta W^{(-i_K)})^{-1} c$$

per tutte le β che soddisfano 2 dal momento che la matrice $\beta W^{(-i_K)}$ risulta substocastica. Se definiamo $M^{(-i_K)} = (I - \beta W^{(-i_K)})^{-1}$ allora, poiché $c = \mathbb{1}$, abbiamo:

$$x^{*(-i_K)} = M^{(-i_K)} \mathbb{1} \tag{7}$$

(g) Per ogni $k \neq i \neq j$ vale:

$$M_{ij} M_{ik} = M_{ii}(M_{ij} - M_{ij}^{(-i)}).$$

(h) Poichè il gioco è simmetrico, da 5, si ottiene che

$$\hat{z} = (I - \beta W)^{-1} \mathbb{1} = M \mathbb{1} \tag{8}$$

Notiamo inoltre da 4 che se il gioco è simmetrico allora anche la matrice M sarà simmetrica. Utilizzando quindi 6 si ottiene:

$$y = \hat{z}' c = (M\mathbb{1})' \mathbb{1} = \mathbb{1}' M \mathbb{1} = \sum_j \sum_k M_{jk} \tag{9}$$

e, analogamente

$$y^{(-i)} = \mathbb{1}' M^{(-i)} \mathbb{1} = \sum_{j \neq i} \sum_{k \neq i} M_{jk}^{(-i)}.$$

A questo punto si ottiene:

$$y - y^{(-i)} = \sum_j \sum_k M_{jk} - \sum_{j \neq i} \sum_{k \neq i} M_{jk}^{(-i)} =$$

$$= \left(\sum_{j \neq i} \sum_{k \neq i} M_{jk} - M_{jk}^{(-i)} \right) + \left(\sum_{k \neq i} M_{ik} \right) + \left(\sum_{j \neq i} M_{ji} \right) + M_{ii}$$

Utilizzando il punto (g): $(M_{ij} - M_{ij}^{(-i)}) = (M_{ij}M_{ik})/M_{ii}$ pertanto [2]

$$y - y^{(-i)} = \left(\sum_{j\neq i}\sum_{k\neq i}\frac{M_{ij}M_{ik}}{M_{ii}}\right) + 2\left(\sum_{j\neq i} M_{ij}\right) + M_{ii} =$$

$$= \frac{1}{M_{ii}}\left(\sum_{j\neq i}\sum_{k\neq i} M_{ij}M_{ik}\right) + 2\left(\sum_{j} M_{ij}\right) - M_{ii} =$$

$$= \frac{1}{M_{ii}}\left(\sum_{j\neq i} M_{ij}\sum_{k} M_{ik} - M_{ii}\sum_{j\neq i} M_{ij}\right) + 2\left(\sum_{j} M_{ij}\right) - M_{ii}$$

Ora, poiché $z_i = \sum_j M_{ij}$ e $\sum_{j\neq i} M_{ij} = z_i - M_{ii}$, otteniamo:

$$y - y^{(-i)} = \frac{1}{M_{ii}}\left(\sum_{j\neq i} M_{ij}(z_i - M_{ii})\right) + 2z_i - M_{ii} =$$

$$= \frac{1}{M_{ii}}(z_i - M_{ii})^2 + 2z_i - M_{ii} = \frac{z_i^2}{M_{ii}}$$

Pertanto il *key player* è quel giocatore i che massimizza il rapporto $\frac{z_i^2}{M_{ii}}$.

[2] Questo passaggio è sempre possibile in quanto $M_{ii} > 0 \quad \forall i \in \mathcal{V}$. Infatti, essendo il grafo simmetrico, abbiamo che $(W^2)_{ii} > 0 \quad \forall i \in \mathcal{V}$. Il risultato segue dalla definizione di M e dal risultato ottenuto attraverso il criterio di Neumann.