混雑ゲーム

九大院シス情 春学期水曜 1 限 ゲーム理論 1 (横尾真 教授)

第5回 アドバンスドトピック

東藤 大樹 (横尾研 准教授)

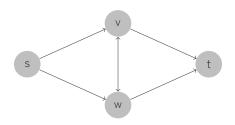
2022年5月18日

- 道路渋滞時の経路選択の状況(を始めとする様々な状況)を表現可能なゲーム理論モデル
 - 各プレイヤのコストが、自分と同じ行動を選択/同じリソースを使用する プレイヤの数に応じて増加するような状況
 - 例えば、スーパーのレジ待ちの行列で、どの列に並ぶか
- ナッシュ均衡の考え方を用いた社会/経済分析
 - ナッシュ均衡が必ずしも社会的に最適とならない例
 - 場当たり的な改善が社会全体の損失を生み出す可能性
 - ゲーム理論の視点からの定量的分析
- 計算機科学者による貢献が顕著な分野

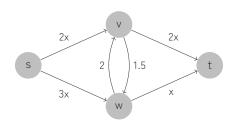
本日の内容

- 混雑ゲームの数理モデル
- 2 ピグーのパラドックス:均衡における非効率
- ③ ブレースのパラドックス:勝手読みによる損失
- ▲ 無秩序の代償 (Price of Anarchy) を用いた定量的分析
- 5 まとめ

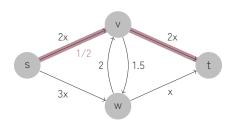
1 混雑ゲームの数理モデル



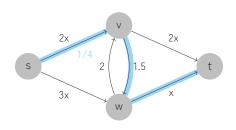
- G(V, E):連結有向グラフ、多重辺があってもよい
- s,t ∈ V: 出発点と到着点; いずれも所与。s **から**t へ、流量 1 を流したい。
- P:全ての s-t パス p の集合
- \blacksquare $p:=\{(s,v_1),(v_1,v_2),\cdots,(v_{k-1},v_k),(v_k,t)\}$:s-t パスはエッジの集合
 - 上の図では、s-v-t, s-w-t, s-v-w-t, s-w-v-t の 4 つの s-t パスが存在



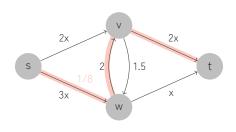
- ullet $c_e:[0,1]
 ightarrow \mathbb{R}_{\geq 0}$:エッジ $e \in E$ のコスト関数;非負、連続、非減少
 - エッジ e を流量 x ∈ [0,1] が通るとき、e 上の各流量はコスト c_e(x) を被る
- フロー f := (f_p)_{p∈P}:各パスを通る流量。
 - 実現可能性制約 $0 \le f_p \le 1 \land \sum_{p \in P} f_p = 1$ を満足するフローの集合 $\mathcal F$
- $lacksymbol{lack}$ $c_p(f_p) := \sum_{e \in p} c_e(f_e)$:パス p のコスト関数
 - ただし、fe:= ∑_{p∈P:e∈p} fp:
 エッジ e を通る流量の総和 fe は、e を含むパスを通る流量の総和



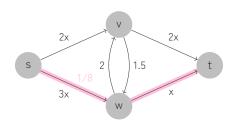
- $lacksymbol{c}$ $c_e:[0,1]
 ightarrow \mathbb{R}_{\geq 0}$:エッジ $e \in E$ のコスト関数;非負、連続、非減少
 - エッジ e を流量 x ∈ [0,1] が通るとき、e 上の各流量はコスト c_e(x) を被る
- フロー f := (f_p)_{p∈P}:各パスを通る流量。
 - 実現可能性制約 $0 \le f_p \le 1 \land \sum_{p \in P} f_p = 1$ を満足するフローの集合 $\mathcal F$
- $lacksymbol{lack}$ $c_p(f_p) := \sum_{e \in p} c_e(f_e)$:パス p のコスト関数
 - ただし、fe:= ∑_{p∈P:e∈p} fp:
 エッジ e を通る流量の総和 fe は、e を含むパスを通る流量の総和



- $lacksymbol{c}$ e : $[0,1]
 ightarrow \mathbb{R}_{\geq 0}$:エッジ $e \in E$ のコスト関数;非負、連続、非減少
 - エッジ e を流量 x ∈ [0,1] が通るとき、e 上の各流量はコスト c_e(x) を被る
- フロー f := (f_p)_{p∈P}:各パスを通る流量。
 - 実現可能性制約 $0 \le f_p \le 1 \land \sum_{p \in P} f_p = 1$ を満足するフローの集合 $\mathcal F$
- $lacksymbol{lack}$ $c_p(f_p) := \sum_{e \in p} c_e(f_e)$:パス p のコスト関数
 - ただし、f_e := ∑_{p∈P:e∈p} f_p:
 エッジe を通る流量の総和 f_e は、e を含むパスを通る流量の総和



- $lacksymbol{c}$ $c_e:[0,1]
 ightarrow \mathbb{R}_{\geq 0}$:エッジ $e \in E$ のコスト関数;非負、連続、非減少
 - エッジ e を流量 x ∈ [0,1] が通るとき、e 上の各流量はコスト c_e(x) を被る
- フロー f := (f_p)_{p∈P}:各パスを通る流量。
 - 実現可能性制約 $0 \le f_p \le 1 \land \sum_{p \in P} f_p = 1$ を満足するフローの集合 $\mathcal F$
- $lacksymbol{lack}$ $c_p(f_p) := \sum_{e \in p} c_e(f_e)$:パス p のコスト関数
 - ただし、f_e := ∑_{p∈P:e∈p} f_p:
 エッジe を通る流量の総和 f_e は、e を含むパスを通る流量の総和



- $lacksymbol{c}$ $c_e:[0,1]
 ightarrow \mathbb{R}_{\geq 0}$:エッジ $e \in E$ のコスト関数;非負、連続、非減少
 - エッジ e を流量 x ∈ [0,1] が通るとき、e 上の各流量はコスト c_e(x) を被る
- フロー f := (f_p)_{p∈P}:各パスを通る流量。
 - 実現可能性制約 $0 \le f_p \le 1 \land \sum_{p \in P} f_p = 1$ を満足するフローの集合 $\mathcal F$
- $lacksymbol{lack}$ $c_p(f_p) := \sum_{e \in p} c_e(f_e)$:パス p のコスト関数
 - ただし、fe:= ∑_{p∈P:e∈p} fp:
 エッジ e を通る流量の総和 fe は、e を含むパスを通る流量の総和

プレイヤ・戦略を定義していないので、厳密な意味ではゲームではないが、 直感的にはゲームと捉えてよい

- 総流量 1をプレイヤの集合と考える
- 一つのフローfは、プレイヤの集合による戦略の組を表す
- プレイヤは、ある s-t パス上のごく微少の流量に相当
 - プレイヤ(微小流量)の戦略は、自分が通る s-t パス
- フロー f のもとでの、あるプレイヤが被るコストは、 自分が通る s-t パスに含まれるエッジのコストの総和
 - より小さいコストのパスを選びたい

Definition (均衡フロー)

あるフロー f が均衡フローであるとは、 $f_p>0$ なる任意の s-t パス $p\in P$ 、および別の任意の s-t パス $\tilde{p}\in P$ について、以下が成り立つことをいう

$$c_p(f_p) \leq c_{\tilde{p}}(f_{\tilde{p}})$$

- f_p > 0 なる任意の s-t パス = プレイヤが存在する s-t パス
- もし別のパス p について cp(fp) > cp(fp) であるならば、
 p 上の少なくともごく微少量のプレイヤにとって、
 p に移動したほうが、コストが低くなるので嬉しい(=均衡とならない)

東藤(横尾研 准教授) 混雑ゲーム 2022-05-18 8/30

- 本日の講義では、社会全体のコスト(総コスト)の最小化を目的とする
- あるフロー f における総コストの定義:

$$\sum_{p\in P} c_p(f_p)*f_p$$

Definition (最適フロー)

ある実現可能なフローfが最適フローであるとは、

別の任意の実現可能なフロー $\tilde{f} \neq f$ について、以下が成り立つことをいう:

$$\sum_{p \in P} c_p(f_p) * f_p \leq \sum_{p \in P} c_p(\tilde{f}_p) * \tilde{f}_p$$

- 本日の講義では、社会全体のコスト(総コスト)の最小化を目的とする
- あるフロー f における総コストの定義:

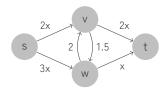
Definition (最適フロー)

ある実現可能なフローfが最適フローであるとは、

別の任意の実現可能なフロー f̃≠fについて、以下が成り立つことをいう:

$$\sum_{p \in P} c_p(f_p) * f_p \leq \sum_{p \in P} c_p(\tilde{f}_p) * \tilde{f}_p$$

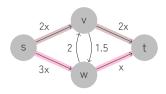
計算その1:均衡フロー



- パス svwt のコスト 3x + 1.5 は、任意の f ∈ F において、 svt のコスト 4x を上回る
 - フローの実現可能性より f_p ≤ 1 であるため
- 同様に、swvt のコスト 5x + 2 は、swt のコスト 4x を上回る
- したがって、均衡フロー f が正の流量を流すパスは svt と swt のみ
- コストが同一となるため、どちらも 1/2 ずつ流れる.このときの総コストは

$$\frac{1}{2} * 4 * \frac{1}{2} + \frac{1}{2} * 4 * \frac{1}{2} = 2$$

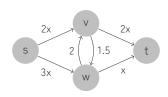
計算その1:均衡フロー



- パス svwt のコスト 3x + 1.5 は、任意の f ∈ F において、 svt のコスト 4x を上回る
 - フローの実現可能性より f_p ≤ 1 であるため
- 同様に、swvt のコスト 5x + 2 は、swt のコスト 4x を上回る
- したがって、均衡フロー f が正の流量を流すパスは svt と swt のみ
- コストが同一となるため、どちらも 1/2 ずつ流れる.このときの総コストは

$$\frac{1}{2} * 4 * \frac{1}{2} + \frac{1}{2} * 4 * \frac{1}{2} = 2$$

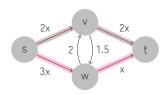
計算その2:最適フロー



- 均衡フローの場合と同様、 パス svwt と swvt のコストはそれぞれ別のパスに支配されるため、 最適フローでは使われない(流量ゼロ)
- 最適フロー f がパス svt に流す流量を x とすると、総コストは以下の式で与えられ、x = 1/2 で最小値 2 を取る

$$x*4x+(1-x)*4(1-x)=8\big((x-\frac{1}{2})^2+\frac{1}{4}\big)$$

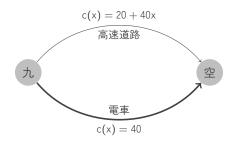
計算その2:最適フロー



- 均衡フローの場合と同様、 パス svwt と swvt のコストはそれぞれ別のパスに支配されるため、 最適フローでは使われない(流量ゼロ)
- 最適フロー f がパス svt に流す流量を x とすると、総コストは以下の式で与えられ、x = 1/2 で最小値 2 を取る

$$x * 4x + (1 - x) * 4(1 - x) = 8((x - \frac{1}{2})^2 + \frac{1}{4})$$

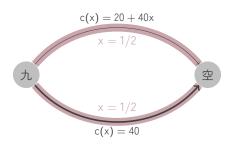
2 ピグーのパラドックス



- 九大学研都市駅から福岡空港まで行きたい
 - 自動車で高速道路を使う場合、所要時間は混雑状況による。高速が空いていれば 20 分、渋滞に巻き込まれると 60 分で、交通量 x に応じて線形

- 電車なら一定時間で着くが、途中停車があり 40 分くらいかかる
- ■(所要時間のみ気にする場合) どちらを選ぶ?

ピグーのパラドックス (Pigou's Paradox)

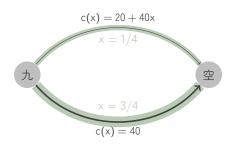


- 均衡フローでは、高速道路と電車の所要時間が一致:それぞれ 1/2 ずつ
- 最適フローでは、1/4 が高速道路を利用し、3/4 が公共交通機関
 - 高速道路利用者の割合を H とすると、総コストは以下となり、H = 1/4 で最小

$$H * (20 + 40H) + (1 - H) * 40 = 40((H - \frac{1}{4})^2 + \frac{15}{16})$$

- 高速道路の所要時間は 20 + 40 * ½ = 30 分
 - → 公共交通機関から高速道路へ変更したい人がいる(均衡フローにならない)

ピグーのパラドックス (Pigou's Paradox)

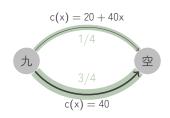


- 均衡フローでは、高速道路と電車の所要時間が一致:それぞれ 1/2 ずつ
- 最適フローでは、1/4 が高速道路を利用し、3/4 が公共交通機関
 - 高速道路利用者の割合を H とすると、総コストは以下となり、H = 1/4 で最小

$$H * (20 + 40H) + (1 - H) * 40 = 40((H - \frac{1}{4})^2 + \frac{15}{16})$$

- 高速道路の所要時間は 20 + 40 * ½ = 30 分
 - → 公共交通機関から高速道路へ変更したい人がいる(均衡フローにならない)

最適フローはなぜ最適か?



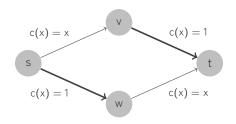
- 均衡フローでないこと(=高速道路を使いたい人の存在)はわかる
- 微少量が高速道路へ変更したフローのほうが、総コストが小さいのでは?
- 変更される微少量 Δx のコストは当然減少:40 \rightarrow $\left(20+40(\frac{1}{4}+\Delta x)\right)$
- 但し、元々高速道路にいたプレイヤのコストも増加するため、全体では増加

$$\frac{1}{4}*40\Delta x$$
 + $\Delta x*(20+40(\frac{1}{4}+\Delta x))$ = $\frac{40\Delta x}{8}$ + $\frac{40(\Delta x)^2}{8}$ 既存プレイヤの 移動プレイヤの 総コスト増加量 増加コスト 増加コスト

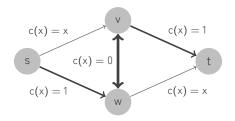
ピグーのパラドックスからの教訓

- 社会的に最適な結果が、個人の希望と一致するとは限らない
 - 囚人のジレンマと類似
 - 今回の最適フローの結果は一見パレート最適ではないが、 嬉しさ・コストが譲渡可能であると思えばパレート最適
 - すなわち、コストの総和を最小化する結果がパレート最適
- 一般に、ナッシュ均衡は社会全体で見れば非効率的
 - 統率なく自由に、無秩序に、行動しているため、ある意味自然
 - 均衡状態が社会にとって効率的となるようなゲームを作れないか? ⇒ メカニズムデザイン(夏学期の講義内容)

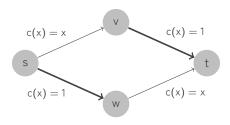
3 ブレースのパラドックス



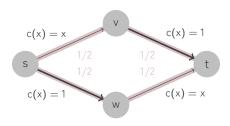
- 交通量によって渋滞が発生(c(x) = x)する細い道路があり、 どちらのルートも混雑しがち。
- 混雑を緩和するために、迂回路を設置する。
 - 混雑が起きないほど広いレーンを持つ高速道路を建設:c(x) = 0
- 混雑はどれだけ緩和されるだろうか?



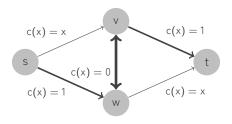
- 交通量によって渋滞が発生(c(x) = x)する細い道路があり、 どちらのルートも混雑しがち。
- 混雑を緩和するために、迂回路を設置する。
 - 混雑が起きないほど広いレーンを持つ高速道路を建設:c(x) = 0
- 混雑はどれだけ緩和されるだろうか?



- 迂回路なしの場合、均衡フロー=最適フロー=それぞれ 1/2。 総コストは 1/2 * (1 + 1/2) * 2 = 3/2
- 迂回路ありの場合:
 - 均衡フローでは、全員 s → v → w → t と迂回。総コストは 1*(1+0+1) = 2。迂回路なしの場合より悪い!
 - 最適フローは迂回路なしの場合と同一。総コスト3/2。

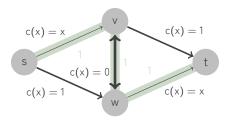


- 迂回路なしの場合、均衡フロー=最適フロー=それぞれ 1/2。 総コストは 1/2 * (1 + 1/2) * 2 = 3/2
- 迂回路ありの場合:
 - 均衡フローでは、全員 s → v → w → t と迂回。総コストは 1*(1+0+1) = 2。迂回路なしの場合より悪い!
 - 最適フローは迂回路なしの場合と同一。総コスト3/2。



- 迂回路なしの場合、均衡フロー=最適フロー=それぞれ 1/2。 総コストは 1/2 * (1 + 1/2) * 2 = 3/2
- 迂回路ありの場合:
 - 均衡フローでは、全員 s → v → w → t と迂回。総コストは 1*(1+0+1) = 2。迂回路なしの場合より悪い!
 - 最適フローは迂回路なしの場合と同一。総コスト 3/2。

ブレースのパラドックス (Braess' Paradox) [1]

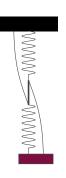


- 迂回路なしの場合、均衡フロー=最適フロー=それぞれ 1/2。 総コストは 1/2 * (1 + 1/2) * 2 = 3/2
- 迂回路ありの場合:
 - 均衡フローでは、全員 s → v → w → t と迂回。総コストは 1 * (1 + 0 + 1) = 2。迂回路なしの場合より悪い!
 - 最適フローは迂回路なしの場合と同一。総コスト 3/2。

- 2つのバネを、間に短いジョイントを 挟んで直列につなぎ、下に重りを吊るす
- 2本の糸を別に準備し、 ごく少しだけ弛ませて以下の通りつなぐ
 - 下のバネからは上の支点へ
 - ■上のバネからは下の重りへ
- ジョイントを外す(切る)と、重りが上がる!



- 2つのバネを、間に短いジョイントを 挟んで直列につなぎ、下に重りを吊るす
- 2本の糸を別に準備し、 ごく少しだけ弛ませて以下の通りつなぐ
 - 下のバネからは上の支点へ
 - 上のバネからは下の重りへ
- ジョイントを外す(切る)と、重りが上がる!

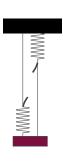


- 2つのバネを、間に短いジョイントを 挟んで直列につなぎ、下に重りを吊るす
- 2本の糸を別に準備し、 ごく少しだけ弛ませて以下の通りつなぐ
 - 下のバネからは上の支点へ
 - 上のバネからは下の重りへ
- ジョイントを外す(切る)と、重りが上がる!



- 2つのバネを、間に短いジョイントを 挟んで直列につなぎ、下に重りを吊るす
- 2本の糸を別に準備し、 ごく少しだけ弛ませて以下の通りつなぐ
 - 下のバネからは上の支点へ
 - 上のバネからは下の重りへ
- ジョイントを外す(切る)と、重りが上がる!





ブレースのパラドックスからの教訓

- 人々が利己的に行動する社会においては、場当たり的なシステムの変更が、 社会全体の非効率を生み出しうる
 - ■『良かれと思って』のような自分本位の考え方は危険
 - システムの変更による人々の行動の変化の精緻な分析が必要
- ゴムの例だと、一本支えを加えることで重りがさらに下がる、という 直感に反する結果が生じる

4 ナッシュ均衡と無秩序の代償

非効率に対して・・・

- ゲームの構造が変更できないのであれば、 非効率な解へ陥ることを抑制することは難しい
 - 人々に、『自由に行動するな!指示に従え!』と言っても無駄
 - Cf. ゲームの構造を変更できるケース
 - **→ メカニズムデザイン**: ゲーム理論 II(夏学期)の内容
- 非効率が生じることは前提に、 どれだけの非効率が生じうるかを定量的に評価したい
 - ■『最悪の場合、社会全体の嬉しさが最適値の 0.*** 倍 (あるいは、社会全体のコストが最適値の *** 倍) になります』 と示したい
 - 近似率解析(データ構造とアルゴリズム)
 - → 計算機科学の得意とするところ

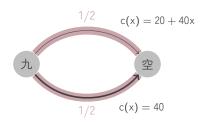
■ 近似率解析の知見をベースに、ゲームが帰着する結果(ナッシュ均衡)が もたらしうる非効率の上界を見積もる

Definition (無秩序の代償 [2])

結果の集合が O、ナッシュ均衡の集合が $NE \subseteq O$ で与えられるゲームの、目的関数 C に関する無秩序の代償 PoA は、以下の式で定義される:

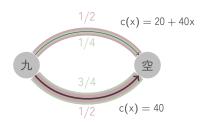
$$PoA = \frac{max_{o \in NE} C(o)}{min_{o^* \in O} C(o^*)}$$

- 分子は、最悪の(=最もコストが大きい)ナッシュ均衡 o における目的関数値
- 分母は、最良の(=最もコストが小さい)**結果** o* における目的関数値 (ナッシュ均衡でなくてもよい)

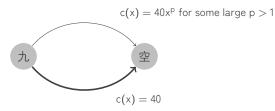


- 上の均衡フローにおけるコストは ½ * 40 + ½ * 40 = 40
 - Non-atomic な混雑ゲームでは、均衡フローが複数あっても、 そのコストは常に同一
- **最適フロー**におけるコストは $\frac{1}{4}*30+\frac{3}{4}*40=\frac{150}{4}$
- このゲームにおける無秩序の代償は 16/15
- 最適時に比べ、総コストが 16/15 倍程度になる可能性がある、と示唆できる

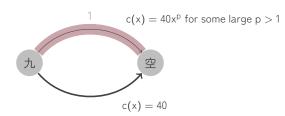
再掲:ピグーのパラドクス



- 上の均衡フローにおけるコストは ½ * 40 + ½ * 40 = 40
 - Non-atomic な混雑ゲームでは、均衡フローが複数あっても、 そのコストは常に同一
- **最適フロー**におけるコストは $\frac{1}{4} * 30 + \frac{3}{4} * 40 = \frac{150}{4}$
- \blacksquare このゲームにおける無秩序の代償は $\frac{16}{15}$
- 最適時に比べ、総コストが 16/15 倍程度になる可能性がある、と示唆できる

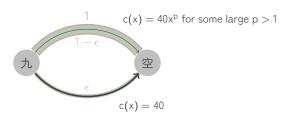


- 非効率(=無秩序の代償)が 16/15 程度であれば、 それほど大きな問題にはならないかも?
 - もちろん、工学的見地からは、より少ないコストを達成することは重要
- 上の図は、無秩序の代償が無限に大きくなる例(ピグーの例の非線形版)
 - 均衡フロー:全員上の道。総コスト 40
 - 最適フロー:微少量 $\epsilon = 1 (p+1)^{-1/p}$ を下の道に移動。 総コスト $40\epsilon + 40*(1-\epsilon)^{p+1}$
 - 無秩序の代償 PoA = $\lim_{p\to\infty} \frac{40}{40\epsilon+40*(1-\epsilon)^{p+1}} = \infty$



- 非効率(=無秩序の代償)が 16/15 程度であれば、 それほど大きな問題にはならないかも?
 - もちろん、工学的見地からは、より少ないコストを達成することは重要
- 上の図は、無秩序の代償が無限に大きくなる例(ピグーの例の非線形版)
 - 均衡フロー:全員上の道。総コスト 40
 - **最適フロー**:微少量 $\epsilon=1-(p+1)^{-1/p}$ を下の道に移動。 総コスト $40\epsilon+40*(1-\epsilon)^{p+1}$
 - 無秩序の代償 PoA = $\lim_{p\to\infty} \frac{40}{40\epsilon+40*(1-\epsilon)p+1} = \infty$

無秩序の代償の上界



- 非効率(=無秩序の代償)が 16/15 程度であれば、 それほど大きな問題にはならないかも?
 - もちろん、工学的見地からは、より少ないコストを達成することは重要
- 上の図は、無秩序の代償が無限に大きくなる例(ピグーの例の非線形版)
 - 均衡フロー:全員上の道。総コスト 40
 - **最適フロー**:微少量 $\epsilon = 1 (p+1)^{-1/p}$ を下の道に移動。 総コスト $40\epsilon + 40*(1-\epsilon)^{p+1}$
 - 無秩序の代償 PoA = $\lim_{p \to \infty} \frac{40}{40\epsilon + 40*(1-\epsilon)^{p+1}} = \infty$

- システムのパフォーマンスの定量的評価を行うツール
 - システム内の意思決定主体が自由に行動するとき、 ナッシュ均衡に基づく無秩序の代償は最悪時のパフォーマンスを保証
 - 目的関数の選び方によって、無秩序の代償は変化しうる
 - 本資料では総コストの最小化を目的関数とした
- 無秩序の代償は常に上界を持つとは限らない
 - 最適解と比較して、パフォーマンスが極めて悪くなる可能性もある (非線形版ピグーのパラドックス)

5 まとめ

本日の内容のまとめ

- 混雑ゲーム/利己的ルーティングゲームの数理モデル
- ピグーのパラドクス (Pigou's Paradox)
 - 一般に、ナッシュ均衡/均衡フローは効率的でない
- ブレースのパラドクス (Braess' Paradox)
 - 場当たり的な制度の変更は、均衡における効率を悪化させうる
- 無秩序の代償 (Price of Anarchy)
 - ゲーム理論に基づく社会システムの定量的分析

質問などは東藤(todo@inf.kyushu-u.ac.jp)まで





Dietrich Braess, Anna Nagurney, and Tina Wakolbinger, (2005). On a Paradox of Traffic Planning. Transportation Science 39(4):446–450.

https://doi.org/10.1287/trsc.1050.0127



Elias Koutsoupias and Christos Papadimitriou, (1999). Worst-Case Equilibria. In: C. Meinel, S. Tison (eds), Proc. STACS 1999. Lecture Notes in Computer Science, vol 1563. Springer, Berlin, Heidelberg. https://doi.org/10.1007/3-540-49116-3_38



Tim Roughgarden, (2011). Routing Games. In: N. Nisan, T. Roughgarden, E. Tardos, V. V. Vazirani (eds), Algorithmic Game Theory, Cambridge University Press.

http://doi.org/10.1017/CB09780511800481.020