

Jaroslav Grigor'evich Kljushin

Информационные пучки в дифференциальных играх

Kybernetika, Vol. 15 (1979), No. 2, (141)--148

Persistent URL: <http://dml.cz/dmlcz/124472>

Terms of use:

© Institute of Information Theory and Automation AS CR, 1979

Institute of Mathematics of the Academy of Sciences of the Czech Republic provides access to digitized documents strictly for personal use. Each copy of any part of this document must contain these

Terms of use.



This paper has been digitized, optimized for electronic delivery and stamped with digital signature within the project *DML-CZ: The Czech Digital Mathematics Library*
<http://project.dml.cz>

Информационные пучки в дифференциальных играх

Ярослав Григорьевич Ключин

В работе Ключина [1] были рассмотрены дифференциальные игры, информационная структура которых задавалась информационными множествами (t -сечениями пучков).

Однако ряд интересных информационных структур требует учета игроками информационной предыстории. В данной статье строится конструкция, позволяющая рассматривать игры на информационных пучках.

1. ОСНОВНАЯ ЛЕММА

1. Начнем с формулировки и доказательства основной Леммы.

Пусть $X \subset R^m$ — фазовое пространство, $[t_0, \theta]$ — промежуток времени, \mathcal{X} — метрическое пространство непрерывных функций:

$$x_\theta : [t_0, \theta] \rightarrow X.$$

Обозначим через x_t сужение x_θ на $[t_0, t]$, $t_0 \leq t \leq \theta$, соответствующее пространство функций обозначим через \mathcal{X}_t .

Пусть задано дифференциальное уравнение

$$(1.1) \quad \frac{dx}{dt} = f(x, x_t),$$

с начальным условием

$$(1.2) \quad x(t_0) = x_0 \in X.$$

Предполагается, что отображение

$$f : X \times \bigcup_{t \in [t_0, \theta]} \mathcal{X}_t \rightarrow X$$

142 ограничено и удовлетворяет условию Липшица:

$$|f(x^1, x_1^1) - f(x^2, x_1^2)| \leq h(|x^1 - x^2| + \varrho_d(x_1^1, x_1^2)),$$

$$x^1, x^2 \in X, x_1^1, x_1^2 \in \mathcal{X}_1, h = \text{const};$$

здесь

$$\varrho_d(x_1^1, x_1^2) = \max_{\tau \in [t_0, t]} |x_1^1 - x_1^2|, x_1^1, x_1^2 \in \mathcal{X}_1.$$

2. Лемма. На некотором сегменте $t - t_0 \leq d$ существует и притом только одно решение уравнения (1.1) с начальным условием (1.2).

Доказательство. Уравнение (1.1) вместе с начальным условием (1.2) эквивалентно интегральному уравнению

$$(1.3) \quad x(t) = x_0 + \int_{t_0}^t f(x(\tau), x_\tau) d\tau.$$

По предположению об ограниченности отображения $f|f(x, x_t)| \leq K = \text{const}$. Подберем d так, чтобы выполнялось условие

$$h \cdot d < \frac{1}{2}.$$

Обозначим через C_d метрическое пространство непрерывных функций, удовлетворяющих дополнительному условию

$$\max_{\tau \in [t_0, d]} |x_d(\tau) - x_0| \leq Kd.$$

Пространство C_d полно, так как оно является замкнутым подпространством полного метрического пространства непрерывных функций на $[t_0, d]$. Заметим, что каждая функция x_d однозначно определяет семейство своих сужений x_t на $[t_0, t]$, $t - t_0 \leq d$ и сама вполне определяется этим семейством.

3. Рассмотрим отображение $z_d = Ax_d$, определяемое формулой

$$z_d(t) = x_0 + \int_{t_0}^t f(x(\tau), x_\tau) d\tau.$$

Отображение A каждую функцию из C_d переводит в некоторую функцию также из C_d при этом A является в C_d сжатием. Действительно, пусть $x_d \in C_d$. Тогда

$$|z_d(t) - x_0| = \left| \int_{t_0}^t f(x(\tau), x_\tau) d\tau \right| \leq Kd;$$

здесь x_t сужение x_d на $[t_0, \tau]$. Следовательно, $A(C_d) \subset C_d$. Кроме того,

$$|z_d^1(t) - z_d^2(t)| \leq \int_{t_0}^t |f(x^1(\tau), x_\tau^1) - f(x^2(\tau), x_\tau^2)| d\tau \leq$$

$$hd \left(\max_{\tau} |x^1(\tau) - x^2(\tau)| + \max_{\tau} \varrho_d(x_\tau^1, x_\tau^2) \right) = 2hd \varrho_d(x_d^1, x_d^2).$$

Так как $hd < \frac{1}{2}$, то A — сжатие, т. е. уравнение имеет единственное решение в пространстве C_d . 143

4. Традиционными для дифференциальных уравнений методами (см., например, Коддингтон и Левинсон [2]) можно показать, что полученное решение продолжимо на весь промежуток $[t_0, \theta]$.

2. ИНФОРМАЦИОННАЯ СТРУКТУРА ДИФФЕРЕНЦИАЛЬНОЙ ИГРЫ

1. Дифференциальную игру задают дифференциальным уравнением вида

$$(2.1) \quad \frac{dx}{dt} = f(x, u^I(t), u^{II}(t)), \quad x(0) = x_0,$$

$$t \in [0, \theta], \quad x \in X \subset \mathbb{R}^n, \quad u^I(t) \in P^I, \quad u^{II}(t) \in P^{II}.$$

Функцию

$$f: X \times P^I \times P^{II} \rightarrow X$$

будем предполагать ограниченной.

Множества альтернатив игроков P^I и P^{II} будем считать компактными подмножествами метрических пространств, начальную точку x_0 для простоты будем считать равной нулю.

2. Функцию

$$u^i: [0, \theta] \rightarrow P^i, \quad i = I, II$$

будем называть программным управлением игрока i , а пару $(u^I(\cdot), u^{II}(\cdot))$ — управляющей функцией.

Решение уравнения (2.1) при фиксированной управляющей функции $(u^I(\cdot), u^{II}(\cdot))$ (если оно существует) будем называть партией и обозначать через $x(\cdot, u^I(\cdot), u^{II}(\cdot))$. Точку $x \in X$ будем называть позицией.

Управляющие функции, для которых существует единственное решение уравнения (2.1), будем называть допустимыми.

3. Если функция f в (2.1)

- 1) измерима по u^I, u^{II} при всяком x ,
- 2) существует константа C такая, что равномерно по u^I, u^{II} , имеет место неравенство

$$|f(x, u^I, u^{II})| \leq C(1 + |x|),$$

- 3) существует константа C_1 такая, что равномерно по u^I, u^{II} имеет место неравенство

$$|f(x_1, u^I, u^{II}) - f(x_2, u^I, u^{II})| \leq C_1(|x_1 - x_2|),$$

то по известным теоремам существования и единственности решения обыкновенного дифференциального уравнения (см., например, Колдингтон и Левинсон [2]) всякая измеримая управляющая функция $(u^I(\cdot), u^{II}(\cdot))$ допустима.

4. Определение. Сужение u_i^i программного управления игрока i на $[0, t]$, $0 < t \leq \theta$ будем называть личным альтернативным t -дебютом игрока i , а пару (u_i^I, u_i^{II}) — альтернативным t -дебютом.

Информационный механизм игры зададим с помощью памяти игроков, т. е. многозначного отображения множества альтернативных t -дебютов в себя

$$(2.2) \quad M^i : \mathcal{U}_t^I \times \mathcal{U}_t^{II} \rightarrow 2^{\mathcal{U}_t^I \times \mathcal{U}_t^{II}},$$

определенного для $i = I, II$ и всех $t \in (0, \theta]$. Сужение на $[0, t]$ партии $x(\cdot, u^I(\cdot), u^{II}(\cdot))$, соответствующее альтернативному t -дебюту (u_i^I, u_i^{II}) , будем называть позиционным t -дебютом и обозначать через $x_t(u_i^I, u_i^{II})$.

5. В содержательных задачах информация игроков обычно определяется их индивидуальной способностью собрать и оценить сведения о „действительном положении дел“ в момент принятия решений. Типичным примером может служить стандартная процедура сбора и оценки разведанных в ходе боя.

Можно сказать, что отображение (2.2) есть количественная характеристика этой способности. Если к текущему моменту t реализовался альтернативный t -дебют (u_i^I, u_i^{II}) („подлинное положение дел“), то память (2.2) определит информацию игрока, т. е. формально задаст сведения $M^i(u_i^I, u_i^{II})$, которыми игрок i будет обладать в момент t .

Можно сказать, что память (2.2) задает отношение на $\mathcal{U}^I \times \mathcal{U}^{II}$. В частности, когда это отношение оказывается рефлексивным, симметричным и транзитивным, предлагаемая информационная схема совпадает с информационной структурой позиционных игр, введенной фон Нейманом и О. Моргенштерном [3].

Определение. Множество позиционных t -дебютов

$$(2.3) \quad \psi_t^i(u_i^I, u_i^{II}) = \{x_t(\bar{u}_i^I, \bar{u}_i^{II}) : (\bar{u}_i^I, \bar{u}_i^{II}) \in M^i(u_i^I, u_i^{II}) \text{ допустимы}\}$$

называется информационным t -пучком.

Пусть Ψ^i — семейство всех информационных пучков игрока i , $\psi^i(0) = \psi_0^i = x_0$, а Ψ_t^i — семейство информационных пучков, задаваемых отображением (2.2) при фиксированном t .

Чистыми стратегиями игроков будем называть функции вида

$$\pi^i : \Psi^i \rightarrow P^i.$$

Каждая ситуация в чистых стратегиях (π^I, π^{II}) реализуется в виде некоторого

альтернативного t -дебюта $(u_t^I, u_t^{II}) (\pi^I, \pi^{II})$ и задает партию как решение (если оно существует) обыкновенного дифференциального уравнения

$$(2.4) \quad \frac{dx}{dt} = f(x, \pi^I, \pi^{II}), \quad x(0) = x_0,$$

получаемого из (2.1) подстановкой (π^I, π^{II}) вместо $(u^I(t), u^{II}(t))$. Однако, конечно, не для всякой ситуации решение будет существовать, поэтому встает вопрос о выделении допустимых ситуаций, т. е. ситуаций которые определяют единственную партию.

3. ДОПУСТИМЫЕ СТРАТЕГИИ

1. Для формулирования условий допустимости выскажем

Предположение 1. При каждом $t \in [0, \theta]$ на семействе информационных t -пучков игрока i определена метрика ρ_t^i .

Если $\Psi_t^i, t \in [0, \theta]$ семейство замкнутых подмножеств пространства \mathcal{X}_t , то это может быть, например, Хаусдорфова метрика (см. Куратовский [4]).

Если Ψ_t^i — конечное семейство информационных пучков (например, конечное разбиение \mathcal{X}_t), то обычно оказывается удобным на Ψ_t^i задавать метрику, определяющую дискретную топологию. Тогда чистые стратегии игроков оказываются автоматически непрерывными: прообраз любого множества в пространстве альтернатив \mathbf{P}^i открыт.

Нам однако не понадобится конкретный вид этих метрик, а требуется лишь выполнение следующих условий.

2. Предположение 2. 1. Требования к памяти. Память игроков такова, что из равенства

$$x(t, \bar{u}_t^I, \bar{u}_t^{II}) = x(t, \bar{u}_t^I, \bar{u}_t^{II})$$

следует равенство

$$M^i(\bar{u}_t^I, \bar{u}_t^{II}) = M^i(\bar{u}_t^I, \bar{u}_t^{II}).$$

Иначе говоря, на альтернативных t -дебютах, приводящих к реализации одной и той же партии, значения памяти игроков должны совпадать.

Отсюда сразу получаем

$$\psi^i(\bar{u}_t^I, \bar{u}_t^{II}) = \psi^i(\bar{u}_t^I, \bar{u}_t^{II}).$$

Обозначим теперь через $\psi^i(x_t)$ функцию

$$\psi^i : \mathcal{X}_t \rightarrow 2^{\mathbf{P}^i}, \quad t \in [0, \theta],$$

$$\psi_i^I(x_i(u_i^I, u_i^{II})) = \psi_i^I(u_i^I, u_i^{II}).$$

2. Условие Липшица. Существует такая константа h , что

(3.1)

$$|f(x_1, u_1^I, u_1^{II}) - f(x_2, u_2^I, u_2^{II})| \leq h(|x_1 - x_2| + \|u_1^I - u_2^I\| + \|u_1^{II} - u_2^{II}\|),$$

$$x_1, x_2 \in X, \quad u_i^I, u_i^{II} \in P^i, \quad i = I, II;$$

(3.2)

$$\|\pi^I(\psi_{i,1}^I) - \pi^I(\psi_{i,2}^I)\| \leq h \varrho_i^I(\psi_{i,1}^I, \psi_{i,2}^I), \quad \psi_{i,1}^I, \psi_{i,2}^I \in \Psi_i^I;$$

(3.3)

$$\varrho_i^I(\psi_i^I(x_i^1), \psi_i^I(x_i^2)) \leq h \varrho_i(x_i^1, x_i^2), \quad x_i^1, x_i^2 \in \mathcal{X}_i;$$

здесь

$$\varrho_i(x_i^1, x_i^2) = \max_{\tau \in [0,1]} |x_i^1(\tau) - x_i^2(\tau)|$$

а ϱ_i^I — метрика, фигурирующая в Предположении 1.

3. Теорема 1. В условиях предположений 1–2 для каждой ситуации в чистых стратегиях (π^I, π^{II}) существует единственное решение уравнения (2.4).

Доказательство сводится к проверке того факта, что композиция функций $g(x, x_i) = f(x, \pi^I(\psi_i^I(x_i)), \pi^{II}(\psi_i^{II}(x_i)))$ удовлетворяет по x и x_i требованиям Леммы параграфа 1.

Подставив (3.3) в (3.2), получим

$$\|\pi^I(\psi_i^I(x_i^1)) - \pi^I(\psi_i^I(x_i^2))\| \leq h^2 \varrho_i(x_i^1, x_i^2).$$

Отсюда с учетом (3.1) получаем

(3.4)

$$|f(x_1, \pi^I(\psi_i^I(x_i^1)), \pi^{II}(\psi_i^{II}(x_i^1))) - f(x_2, \pi^I(\psi_i^I(x_i^2)), \pi^{II}(\psi_i^{II}(x_i^2)))|$$

$$\leq h^3(|x_1 - x_2| + 2\varrho_i(x_i^1, x_i^2)).$$

Неравенство (3.4) означает, что правая часть уравнения (2.4) удовлетворяет условиям Леммы.

4. ЭКВИВАЛЕНТНОСТЬ СТРАТЕГИЙ

1. Определение. Две стратегии игрока I $\bar{\pi}^I$ и $\tilde{\pi}^I$ будем называть эквивалентными, если для всех стратегий партнера π^{II} при всех $t \in [0, \theta]$ выполняется равенство

$$x(t, \bar{\pi}^I, \pi^{II}) = x(t, \tilde{\pi}^I, \pi^{II}).$$

Каждая ситуация (π^I, π^{II}) в силу соотношения (2.4) определяет некоторый альтернативный t -дебют $(u_t^I, u_t^{II})(\pi^I, \pi^{II})$. Информационный t -пучок, определяемый $M^I((u_t^I, u_t^{II})(\pi^I, \pi^{II}))$, обозначим через $\psi_t^I(\pi^I, \pi^{II})$.

Пусть P^{II} — множество всех допустимых стратегий игрока II. Положим

$$\begin{aligned} X_I(\pi^I) &= \{x_t(\pi^I, \pi^{II}) : \pi^{II} \in P^{II}\}, \\ \Psi_I^I(\pi^I) &= \{\psi_t^I(\pi^I, \pi^{II}) : \pi^{II} \in P^{II}\}. \end{aligned}$$

2. Теорема 2. Для того, чтобы две стратегии $\bar{\pi}^I$ и $\tilde{\pi}^I$ игрока I были эквивалентны достаточно, чтобы при всех t выполнялись равенства

$$(4.1) \quad \begin{aligned} X_I(\bar{\pi}^I) &= X_I(\tilde{\pi}^I), \\ \Psi_I^I(\bar{\pi}^I) &= \Psi_I^I(\tilde{\pi}^I) \end{aligned}$$

и для любого информационного пути $\psi_t^I \in \Psi_I^I$, $t \in [0, \theta]$ при почти всех t выполнялось равенство

$$(4.3) \quad \bar{\pi}^I(\psi_t^I) = \tilde{\pi}^I(\psi_t^I).$$

Доказательство. Пусть игрок II выбрал свою произвольную стратегию π^{II} . Тогда какую бы стратегию $\bar{\pi}^I$ или $\tilde{\pi}^I$ ни выбрал игрок I, реализующийся информационный путь $\psi_t^I \in \Psi_I^I(\bar{\pi}^I)$, а¹ тогда в силу (4.3) вдоль этого пути при почти всех t

$$f(x, \bar{\pi}^I(\psi_t^I), \pi^{II}) = f(x, \tilde{\pi}^I(\psi_t^I), \pi^{II}).$$

Интегрируя это равенство, получим требуемое.

Легко привести пример, показывающий, что для неединственности по альтернативам игрока I правых частей уравнения (2.1) условия Теоремы 2 не являются необходимыми.

Теорема 3. Если функция f в уравнении (2.1) взаимнооднозначная функция альтернатив игрока I и u^I (при фиксированных x и u^{II}), то условия Теоремы 2 и необходимы для эквивалентности стратегий $\bar{\pi}^I$ и $\tilde{\pi}^I$.

Доказательство. По определению эквивалентных стратегий для всех $t \in [0, \theta]$ и $\pi^{II} \in P^{II}$ $x(t, \bar{\pi}^I, \pi^{II}) = x(t, \tilde{\pi}^I, \pi^{II})$ и следовательно

$$(4.4) \quad x_t(\bar{\pi}^I, \pi^{II}) = x_t(\tilde{\pi}^I, \pi^{II}),$$

т. е.

$$X_I(\bar{\pi}^I) = X_I(\tilde{\pi}^I).$$

В силу пункта 1 Предположения 2 из (4.4) получим

$$\psi_t^I(x_t(\bar{\pi}^I, \pi^{II})) = \psi_t^I(x_t(\tilde{\pi}^I, \pi^{II})),$$

$$\Psi_t^1(\bar{\pi}^1) = \Psi_t^1(\pi^1).$$

Равенство (4.3) докажем от противного. Предположим, что найдутся информационный путь $\psi_t^1 \in \Psi_t^1(\bar{\pi}^1)$ и множество $T_0 \subset [0, \theta]$ ненулевой лебеговой меры такие, что для $t \in T_0$

$$\bar{\pi}^1(\psi_t^1) \neq \bar{\pi}^1(\psi_t^1).$$

Но тогда для $t \in T_0$ в силу взаимной однозначности функции f по u^1

$$(4.5) \quad f(x(t), \bar{\pi}^1(\psi_t^1), \pi^{11}) \neq f(x(t), \bar{\pi}^1(\psi_t^1), \pi^{11}).$$

Рассмотрим дифференциальные уравнения

$$\frac{dx}{dt} = f(x, \bar{\pi}^1(\psi_t^1), \pi^{11}), \quad x(0) = x_0$$

и

$$\frac{dx}{dt} = f(x, \bar{\pi}^1(\psi_t^1), \pi^{11}), \quad x(0) = x_0.$$

Пусть $\bar{x}(t)$ и $\tilde{x}(t)$ — решения этих уравнений. Из (4.5) получаем: для $t \in T_0$

$$\frac{d\bar{x}(t)}{dt} \neq \frac{d\tilde{x}(t)}{dt}$$

и следовательно по крайней мере для некоторых $t \in [0, \theta]$

$$\bar{x}(t) \neq \tilde{x}(t)$$

что противоречит предположению об эквивалентности $\bar{\pi}^1$ и $\bar{\pi}^1$.

(Поступило в редакцию 5 сентября 1978.)

ЛИТЕРАТУРА

- [1] Я. Г. Ключин: Информационная структура и эквивалентность стратегий в дифференциальных играх. Доклады Академии Наук СССР 232 (1977), 1, 20—23.
- [2] Э. А. Коддингтон, Н. Левинсон: Теория обыкновенных дифференциальных уравнений. ИЛ, Москва 1958.
- [3] Дж. фон Нейман, О. Моргенштерн: Теория игр и экономическое поведение. Наука, Москва 1970.
- [4] К. Куратовский: Топология. Т. I, Москва, Мир 1966.

Ярослав Григорьевич Ключин, научный сотрудник Института Социально-Экономических Проблем Академии Наук СССР, Ленинград, ул. Воинова, 50-а. СССР.