

DOI:

О НЕКОТОРОЙ ДИФФЕРЕНЦИАЛЬНОЙ ИГРЕ СО МНОГИМИ КРИТЕРИЯМИ

Мохонько Е.З.

Вычислительный центр им. А.А.Дородницына ФИЦ ИУ РАН,

Россия, г. Москва, ул. Вавилова, д.40

mohon@ccas.ru

Аннотация: Рассматривается дифференциальная игра двух лиц со многими критериями. Если внутренность пересечения некоторых мостов не пуста, то существует гарантия по Слейтеру в позиционных стратегиях. Из непустоты пересечения также следует, что гарантия сохраняется при счетном числе моментов получения информации о порожденной траектории.

Ключевые слова: дифференциальная многокритериальная игра, гарантия по Слейтеру, режим получения информации, стабильный мост.

Введение

Данная работа посвящена поиску оптимального режима получения информации в многокритериальной дифференциальной игре. Многокритериальные динамические модели принятия решений на основе дискретной информации являются обычно более точным отображением реальности по сравнению с однокритериальными моделями, в которых используется непрерывно поступающая информация. Так что тема работы важна и актуальна.

Ряд математиков [1], [2] рассмотрел игровые модели, в которых дискретная информация, получаемая в специально подобранные моменты времени, оказывалась столь же эффективной, что и информация, получаемая непрерывным образом. Многокритериальные дифференциальные игры тоже уже рассматривались, например, в [3]. В данной работе соединены эти два направления.

Структуры различных оптимальных по Слейтеру стратегий здесь представлены с использованием стабильных мостов, а не дельта трубочки, как в [4].

Даны определения максимального, минимального и гарантированного решения по Слейтеру, найдены достаточные условия существования гарантированного решения в позиционных стратегиях и построено это оптимальное решение. То же самое сделано и для r - стратегий, которые позволяют получать информацию как дискретным, так и непрерывным способами.

Во всех определениях оптимальных решений по Слейтеру присутствует требование единственности порождаемого стратегиями движения. В оптимальных r - стратегиях получение информации об этом движении дискретно.

Так достигается цель данной работы – найти дискретный режим получения информации о траектории, порождаемой гарантированным по Слейтеру решением в r - стратегиях.

1 Гарантированное решение в позиционных стратегиях

Рассмотрим многокритериальную задачу принятия решений при неопределенности

$$\langle \bar{U}, \bar{V}, (I^1(u, v) = g^1(x(T)), \dots, I^N(u, v) = g^N(x(T))) \rangle,$$

$$(1) \dot{x} = f(x, t, u, v), t_0 \leq t \leq T,$$

$$(2) x(t_0) = x^0,$$

$$u \in P, v \in Q,$$

$$I^1(u, v) = g^1(x(T)), \dots, I^N(u, v) = g^N(x(T)).$$

Здесь x - n - мерный вектор состояния, u и v - p - и q - мерные вектор – функции. u - управление, значения которого выбирают лицом, принимающим решения (ЛПР), с целью сделать как можно больше N своих функций целей $I^1(u, v) = g^1(x(T)), \dots, I^N(u, v) = g^N(x(T))$, при том, что неопределенность (помеха) v может быть любой, $v \in Q$. $g^1(x(T)), \dots, g^N(x(T))$, непрерывны. N - количество компонент в вектор - функции цели.

Множества P и Q - компактны в соответствующих векторных пространствах. Вектор-функция $f(x, t, u, v)$ непрерывна по всем своим аргументам и удовлетворяет ограничениям из [5]. Выполняется условие существования седловой точки в маленькой игре [5].

Множеством допустимых стратегий ЛПР и помехи \bar{U}, \bar{V} является множество измеримых по всем своим аргументам позиционных $u(x, t)$, $v(x, t)$ и программных $u(t)$, $v(t)$ управлений, удовлетворяющих включению $u \in P, v \in Q$, а также r -стратегии \bar{u}, \bar{v} [1], которые позволяют получать информацию о

позиции как непрерывным, так и дискретным образом. Используется формализм ломаных Эйлера [5] и модифицированных А.Ф.Кононенко движений [1].

Напоминание определения r -стратегий будет сделано в этой статье позже, когда надо будет найти гарантированное по Слейтеру решение в r -стратегиях.

$X[t_*, x_*, u(x, t), v(x, t)]$ - множество движений, исходящих из t_*, x_* , если ЛППР применяет стратегию $u(x, t)$, а стратегия неопределенности описывается $v(x, t)$. $X[t_*, x_*, u(x, t)]$ - множество движений, исходящих из t_*, x_* , если ЛППР применяет стратегию $u(x, t)$. И мы не интересуемся, из каких соображений выбирает свое управление помеха. $X[t_*, x_*, u(x, t)] \supset X[t_*, x_*, u(x, t), v(x, t)] \forall v(x, t)$. Аналогично определяются пучки движений

$X[t_*, x_*, \bar{u}], X[t_*, x_*, \bar{v}], X[t_*, x_*, \bar{u}, \bar{v}]$ при применении игроками Γ - стратегий \bar{u} и \bar{v} .

Пусть $u^* \in \bar{U}$ - некоторая фиксированная стратегия из множества допустимых стратегий ЛППР.

Пусть $v^* \in \bar{V}$ - некоторая фиксированная стратегия из множества допустимых стратегий помехи.

Следуя [6] многокритериальной задаче при неопределенности

$$(3) \langle \bar{U}, \bar{V}, (I^1(u, v) = g^1(x(T)), \dots, I^N(u, v) = g^N(x(T))) \rangle$$

поставим в соответствии две многокритериальные задачи

$$(4) \langle \bar{V}, (I^1(u^*, v) = g^1(x(T)), \dots, I^N(u^*, v) = g^N(x(T))) \rangle \text{ и}$$

$$(5) \langle \bar{U}, (I^1(u, v^*) = g^1(x(T)), \dots, I^N(u, v^*) = g^N(x(T))) \rangle$$

Для этих задач, опираясь на [6], [4], определим понятия векторных максимума и минимума.

Минимум по Слейтеру. Неопределенность $v^* \in \bar{V}$ называется *минимальной по Слейтеру* для задачи (4) в позиционных стратегиях, если выполнены два требования. Они такие:

Пара (u^*, v^S) порождает решение $x^0(t), t \in [t_0, T]$ задачи (1), (2), которое является и единственным движением,

несовместна система неравенств

$$\begin{cases} I^1(u^*, v^S) > \min_{x[t, x^0(t), u]} g^1(x(T)), \\ \dots \\ I^N(u^*, v^S) > \min_{x[t, x^0(t), u]} g^N(x(T)). \end{cases}$$

Максимум по Слейтеру. Альтернатива $u^* \in \bar{U}$ называется *максимальной по Слейтеру* для задачи (5) в позиционных стратегиях, если выполнены два требования. Они такие:

- Пара (u^S, v^*) порождает решение $x^0(t), t \in [t_0, T]$ задачи (1), (2), которое является и единственным движением,
- несовместна система неравенств

$$\begin{cases} I^1(u^S, v^*) < \max_{x[t, x^0(t), v^*]} g^1(x(T)), \\ \dots \\ I^S(u^S, v^*) < \max_{x[t, x^0(t), v^*]} g^S(x(T)). \end{cases}$$

Определение. Пару $[u^S, (I^{1,S}, \dots, I^{N,S})]$ назовем **гарантированным решением задачи (3)** в позиционных стратегиях, если выполнены следующие требования 1, 2, 3.

1. Пара (u^S, v^S) порождает решение $x^0(t), t \in [t_0, T]$ задачи (1), (2), которое является и единственным движением, то есть $\forall t \in [t_0, T]$ пучок движений состоит из единственного движения $X[t, x^0(t), u^S, v^S] = \{x^0(\tau), t \leq \tau \leq T\}$.

2. Существует неопределенность $v^S \in \bar{V}$ для которой $I^{1,S} = I^1(u^S, v^S), \dots, I^{N,S} = I^N(u^S, v^S)$ и альтернатива u^S является максимальной по Слейтеру в задаче

$$\langle \bar{U}, (I^1(u, v^S) = g^1(x(T)), \dots, I^N(u, v^S) = g^N(x(T))) \rangle$$

3. Неопределенность v^S является минимумом по Слейтеру в задаче

$$\langle \bar{V}, (I^1(u^S, v) = g^1(x(T)), \dots, I^N(u^S, v) = g^N(x(T))) \rangle.$$

Пусть $\exists i, \exists j, i \in 1, \dots, N, j \in 1, \dots, N$, и $x^0(t), t \in [t_0, T]$ порождено кусочно-постоянными управлениями $u^0(t), v^0(t), x^0(t) \in (G_v^j \setminus \partial G_v^j) \cap (G_u^i \setminus \partial G_u^i), t \in [t_0, T]$. Здесь G_u^i - максимальный u -стабильный мост [5], к множеству $\{x, T | g^i(x(T)) \geq g^i(x^0(T))\}$, ∂G_u^i - его граница, $u^{ext}(x, t)$ - экстремальная [5] стратегия к этому мосту.

G_v^j - максимальный v -стабильный мост к множеству $\{x, T | g^j(x(T)) \geq g^j(x^0(T))\}$,
 ∂G_v^j - его граница, $v^{ext}(x, t)$ - экстремальная стратегия к этому мосту.

$$v^0(x, t) = \begin{cases} v^0(t), & (x, t) \in G_v^j, \\ v^{ext}(x, t), & (x, t) \notin G_v^j, \end{cases} \quad u^0(x, t) = \begin{cases} u^0(t), & (x, t) \in G_u^i, \\ u^{ext}(x, t), & (x, t) \notin G_u^i. \end{cases}$$

Пара $[u^0(x, t), (I^1(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^1(x^0(T)), \dots, I^N(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^N(x^0(T)))]$ является гарантированным решением задачи (3). Докажем это.

То, что пара $u^0(x, t), v^0(x, t)$ порождает решение $x^0(t)$, которое является и единственным движением, следует из вида функций $u^0(x, t), v^0(x, t)$ и включения $x^0(t) \in (G_v^j \setminus \partial G_v^j) \cap (G_u^i \setminus \partial G_u^i), t \in [t_0, T]$.

Альтернатива $u^0(x, t)$ является максимальной по Слейтеру в задаче

$$\langle \bar{U}, (I^1(u, v^0(x, t)) = g^1(x(T)), \dots, I^N(u, v^0(x, t)) = g^N(x(T))) \rangle.$$

$\forall t \in [t_0, T]$ любое движение из пучка движений $X[t, x^0(t), v^0(x, t)]$ в момент T будет находиться во множестве $\{x, T | g^j(x(T)) \leq g^j(x^0(T))\}$. Это следует из свойств моста G_v^j . Значит, несовместна система неравенств

$$\begin{cases} I^1(u^0(x, t), v^0(x, t)) < \max_{X[t, x^0(t), v^0(x, t)]} g^1(x(T)), \\ I^l(u^0(x, t), v^0(x, t)) < \max_{X[t, x^0(t), v^0(x, t)]} g^l(x(T)), \\ I^N(u^0(x, t), v^0(x, t)) < \max_{X[t, x^0(t), v^0(x, t)]} g^N(x(T)). \end{cases}$$

Где $I^j(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^j(x^0(T))$.

Неопределенность $v^0(x, t)$ является минимумом по Слейтеру в задаче

$$\langle \bar{V}, (I^1(u^0(x, t), v) = g^1(x(T)), I^2(u^0(x, t), v) = g^2(x(T))) \rangle.$$

$\forall t \in [t_0, T]$ любое движение из пучка движений $X[t, x^0(t), v^0(x, t)]$ в момент T будет находиться во множестве $\{x, T | g^i(x(T)) \leq g^i(x^0(T))\}$. Это следует из свойств моста G_u^i . Значит, несовместна система неравенств

$$\begin{cases} I^1(u^0(x, t), v^0(x, t)) < \min_{X[t, x^0(t), v^0(x, t)]} g^1(x(T)), \\ I^l(u^0(x, t), v^0(x, t)) < \min_{X[t, x^0(t), v^0(x, t)]} g^l(x(T)), \\ I^N(u^0(x, t), v^0(x, t)) < \min_{X[t, x^0(t), v^0(x, t)]} g^N(x(T)). \end{cases}$$

Где $I^k(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^k(x^0(T))$.

Таким образом, требования 1,2,3 выполнены и пара $[u^0(x, t), (I^1(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^1(x^0(T)), \dots, I^N(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^N(x^0(T)))]$ является гарантированным решением задачи (3) в позиционных стратегиях.

Теорема 1. Пара $[u^0(x, t), (I^1(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^1(x^0(T)), \dots, I^N(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^N(x^0(T)))]$

является гарантированным решением задачи (3).

Теорема 2.

Достаточным условием существования гарантированного решения задачи (3) в позиционных стратегиях является требование $D_x^k \neq \emptyset$.

Здесь $D_x^k = (x(t)) \in X[t_0, x^0, U^k, V^k]$

$$\exists i \in \{1, \dots, N\}, \exists j \in \{1, \dots, N\}, x(t) \in (G_u^i \setminus \partial G_u^i) \cap (G_v^j \setminus \partial G_v^j), \forall t \in [t_0, T],$$

$U^k(V^k)$ - множество всех допустимых кусочно-постоянных управлений $u(t), v(t)$.

Пример.

$$\dot{x}_1 = v, x_1(0) = 0, \dot{x}_2 = u, x_2(0) = \frac{3}{4}, 0 \leq t \leq 1, 0 \leq u \leq 1, 0 \leq v \leq 1,$$

$$I^1(u, v) = g^1(x(1)) = x_1(1) - \frac{1}{2}x_2(1), I^2(u, v) = g^2(x(1)) = x_2(1) - \frac{1}{2}x_1(1).$$

ЛПР и помеха могут применять допустимые программные и позиционные управления.

Обозначим $\bar{A} = \{x_1, x_2, t | (0 \leq t \leq 1) \wedge (0 \leq x_1 \leq 1) \wedge (\frac{3}{4} \leq x_2 \leq 1 \frac{3}{4})\}$, $x = (x_1, x_2)$,

$$G_v^1 = \left\{ (x, t) \in \bar{A} \left| \min_{v(x,t)} \max_{x[t,x(t),v(x,t)]} g^1(x(1)) \leq g^1(x^0(1)) \right. \right\},$$

$$G_u^2 = \left\{ (x, t) \in \bar{A} \left| \max_{u(x,t)} \min_{x[t,x(t),u(x,t)]} g^2(x(1)) \geq g^2(x^0(1)) \right. \right\}.$$

Пусть $x_1^0(t) = t$, $v^0(t) = 1$, $x_2^0(t) = \frac{3}{4} + \frac{1}{4}t$, $u^0(t) = \frac{1}{4}$, $0 \leq t \leq 1$.

Тогда $g^1(x^0(1)) = \frac{1}{2}$, $g^2(x^0(1)) = \frac{1}{2}$.

$$\min_v \max_{x[t,x^0(t),v(x,t)]} g^1(x(1)) = t - \frac{1}{2} \left(\frac{3}{4} + \frac{1}{4}t \right) = \frac{7}{8}t - \frac{3}{8} < \frac{1}{2}, x^0(t) \in (G_v^1 \setminus \partial G_v^1), 0 \leq t \leq 1.$$

$$\max_u \min_{x[t,x^0(t),u(x,t)]} g^2(x(1)) = \frac{3}{4} + \frac{1}{4}t + (1-t) - \frac{1}{2}t - \left(\frac{1}{2} \right) (1-t) = \frac{5}{4} - \frac{3}{4}t > \frac{1}{2}, 0 \leq t \leq 1.$$

$x^0(t) \in (G_u^2 \setminus \partial G_u^2)$, $0 \leq t \leq 1$. Следовательно, $x^0(t) \in (G_v^1 \setminus \partial G_v^1) \cap (G_u^2 \setminus \partial G_u^2)$, $0 \leq t \leq 1$.

$$v^0(x, t) = \begin{cases} 1, & (x, t) \in G_v^1, \\ 0, & (x, t) \notin G_v^1, \end{cases} \dots u^0(x, t) = \begin{cases} \frac{1}{4}, & (x, t) \in G_u^2, \\ 1, & (x, t) \notin G_u^2. \end{cases}$$

Пара $[u^0(x, t), (I^1(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^1(x^0(T)), I^2(u^0(x, t), v^0(x, t)) = g^2(x^0(T)))]$ является гарантированным решением задачи (3) в позиционных стратегиях.

2 Гарантированное решение в r - стратегиях

Определения оптимальных по Слейтеру решений в r -стратегиях аналогичны определениям оптимальных по Слейтеру решений в позиционных стратегиях. Построенное гарантированное решение в r - стратегиях порождает траекторию, информацию о которой игроки получают не более, чем счетное число раз.

Определение гарантированного решения в r - стратегиях делается аналогично тому, как это было сделано для позиционных стратегий.

Найдем пару, которая является гарантированным решением задачи (3) в r - стратегиях и обеспечивает игрокам не более чем счетное число моментов получения информации об $x^0(t)$.

Напомним определение r - стратегий [1].

Определение: r - стратегией \bar{u} игрока 1 называется пара $\bar{u} = (r, u(\cdot))$, ставящая в соответствие каждой точке (x, t)

1) неотрицательное число $r \geq 0$,

Если $r > 0$, то измеримую функцию $u(\theta), \dots u(\cdot) = \{u(\theta) = u(x, t; \theta) \in P | t \leq \theta < t + r(x, t)\}$,

Если $r = 0$, то управление в точке (x, t) $u(\cdot) = u(x, t)$.

Аналогично определяется r - стратегия \bar{v} игрока 2.

В [1] определено понятие ломаной Эйлера $x_\Delta(t) = x_\Delta(t; x^*, t_*, \bar{u}, v(\cdot))$ и движения $x(t) = x(t; x^*, t_*, \bar{u})$, порожденных r - стратегией \bar{u} из позиции (x^*, t_*) . В [1],[7] определено, какие моменты называется моментами получения информации для ломаных Эйлера и движений, порожденных r - стратегиями.

Обозначим

$X[x, t, u^0(\tau)](X[x, t, v^0(\tau))$ - множество движений, исходящих из точки x, t и порожденных кусочно-постоянной стратегией $u^0(\tau)$ ($v^0(\tau)$), $\tau \in [t, T]$.

$$x^0(t) \in (G_v^j \setminus \partial G_v^j) \cap (G_u^i \setminus \partial G_u^i), t \in [t_0, T].$$

Рассмотрим позиционные стратегии $u^0(x, t), v^0(x, t)$ вида

$$u^0(x, t) = \begin{cases} u^0(t), & (x, t) \in G_u^i, \\ u^{ext}(x, t), & (x, t) \notin G_u^i, \end{cases} \quad v^0(x, t) = \begin{cases} v^0(t), & (x, t) \in G_v^j, \\ v^{ext}(x, t), & (x, t) \notin G_v^j. \end{cases}$$

Здесь $u^{ext}(x, t)$ - стратегия, экстремальная к мосту G_u^i , $v^{ext}(x, t)$ - стратегия экстремальная к мосту G_v^j . Решение $x^0(t) \in D_x^k$ порождено кусочно-постоянными управлениями $u^0(t), v^0(t)$.

$$\bar{T}_u^i(x, t) = \{\bar{t} | \bar{t} \in [t, T], \exists x(\tau; x, t, u^0(\tau)) \in X[x, t, u^0(\tau)],$$

$$\exists t_2: x(\tau; x, t, u^0(\tau)) \notin G_u^i \forall \tau \in (\bar{t}, t_2), t_2 \in (\bar{t}, T\}].$$

Если $\overline{T}_u^i(x, t)$ существует, то $\omega_{u^0}^i(x, t) = \inf_{\bar{t} \in \overline{T}_u^i(x, t)} \bar{t}$ при $(x, t) \in G_u^i$

Если $\overline{T}_u^i(x, t)$ не существует, тогда $\omega_{u^0}^i(x, t) = T$.

$\omega_{u^0}^i(x, t) = t$ при $(x, t) \notin G_u^i, \omega_{uc}^i(x, t) = \omega_{u^0}^i(x, t) - t$.

$$\overline{T}_v^j(x, t) = \{\bar{t} | \bar{t} \in [t, T], \exists x(\tau; x, t, v^0(\tau)) \in X[x, t, v^0(\tau)],$$

$$\exists t_2: x(\tau; x, t, v^0(\tau)) \notin G_v^j \forall \tau \in (\bar{t}, t_2), t_2 \in (\bar{t}, T\}].$$

Если $\overline{T}_v^j(x, t)$ существует, то $\omega_{v^0}^j(x, t) = \inf_{\bar{t} \in \overline{T}_v^j(x, t)} \bar{t}$ при $(x, t) \in G_v^j$.

Если $\overline{T}_v^j(x, t)$ не существует, тогда $\omega_{v^0}^j(x, t) = T$. $\omega_{v^0}^j(x, t) = t$ при $(x, t) \notin G_v^j$.

$$\omega_{vc}^j(x, t) = \omega_{v^0}^j(x, t) - t.$$

Можно показать, что $[\overline{u}^0, (I^1(\overline{u}^0, \overline{v}^0) = g^1(x^0(T)), \dots, I^N(\overline{u}^0, \overline{v}^0) = g^N(x^0(T)))]$

является гарантированным решением задачи (3) в r - стратегиях.

$$\overline{u}^0 = \begin{cases} r(x, t) = \omega_{uc}^i(x, t), (x, t) \in G_u^i, r(x, t) = 0, (x, t) \notin G_u^i, \\ \{u^0(\tau) | t \leq \tau < t + r\}, r(x, t) > 0, (x, t) \in G_u^i, \\ u^0(t), (x, t) \in G_u^i, r = 0, \\ u^{ext}(x, t), (x, t) \notin G_u^i. \end{cases}$$

$$\overline{v}^0 = \begin{cases} r(x, t) = \omega_{vc}^j(x, t), (x, t) \in G_v^j, r(x, t) = 0, (x, t) \notin G_v^j, \\ \{v^0(\tau) | t \leq \tau < t + r\}, r(x, t) > 0, (x, t) \in G_v^j, \\ v^0(t), (x, t) \in G_v^j, r = 0, \\ v^{ext}(x, t), (x, t) \notin G_v^j. \end{cases}$$

Порождается та же траектория $x^0(t)$, которая порождалась позиционными стратегиями, образующие гарантированное по Слейтеру решение.

Методами работы [1] доказывается, что каждый игрок получает информацию об $x^0(t)$ не более, чем счетное число раз, так как в окрестности $x^0(t)$ $r(x, t) > 0$ и $r(x^0(t), t) > 0$.

Заключение

Достаточное условие существования гарантированного по Слейтеру решения в позиционных стратегиях и в r - стратегиях дается с применением конструкций стабильных мостов. Такой подход перспективный. Его можно применить и для изучения других принципов оптимальности в многокритериальных дифференциальных задачах. Например, для АА - гарантированного решения [6], стр.102. А также для нахождения оптимальных режимов получения информации в АА - гарантированном решении.

Литература

1. Кононенко А.Ф., Мохонько Е.З. О процессе получения информации в неантагонистических дифференциальных играх //Сообщения по прикладной математике. – М.:ВЦ АН СССР,1982, – 20с.
2. Черноусько Ф.Л., Меликян А.А. Игровые задачи управления и поиска.– М.: Наука,1978. –270с
3. Жуковский В.И., Салуквадзе М.Е. Оптимизация гарантий в многокритериальных задачах управления.- Тбилиси: «Мецниереба»,1996. – 475с
4. Кононенко А.Ф. Структура оптимальной стратегии в динамических управляемых системах //Ж.вычисл. матем. и матем. физ.1980. 20,№5. – С.1105-1116.
5. Красовский Н.Н., Субботин А.Н. Позиционные дифференциальные игры.– М.: Наука, 1974. – 6. 456с.
7. Жуковский В.И., Жуковская Л.В. Риск в многокритериальных и конфликтных системах при неопределенности.- М.: Издательство ЛКИ,2010.- 272с.
8. Мохонько Е.З. Дифференциальная неантагонистическая игра с дополнительным платежом. Сборник научных трудов XIII Международной школы – симпозиума «Анализ, моделирование, управление, развитие социально – экономических систем (АМУР-2019)», 14-27 сентября 2019г.

Сборник научных трудов. Симферополь-Судак. Симферополь: ИП Корниенко, 2019. – С.289-295.