

区分的動的計画法について

南山大学経営学部

沢木 勝茂

1. はじめに

Blackwell[1], Denardo[2], Strauch[6] らは単調かつ縮小写像の仮定の下で一般的な動的計画法を考察している。本稿では、Denardo[2]の仮定の下における動的計画法の特別なクラスについて議論する。このクラスの動的計画法は次のような区分的な性質を有する。もし最終費用が区分的性質を有するならば、費用関数もまた区分的性質を有する。ここで区分的性質とは、関数が分割の部分集合上では、同一の性質を有することと意味する。例えば、部分観測可能なマルコフ決定過程[5], [7] は区分的線形の性質を有し、ある種の確率的在庫モデルは区分的凹の性質をもっている。その他、経済学や経営管理モデルなどにおける費用関数が区分的性質を有する場合が多い。Larson[3]や Sawaki[4]は区分的動的計画法の特別な場合がある。

本稿では、区分的動的計画法は一般的動的計画法に対し ε -最適な費用と ε -最適な政策が常に存在することとを示す。更に、そのような ε -最適費用関数と ε -最適政策と次々と生成するためのアルゴリズムを提供する。

2. 区分的動的計画法

最初に Denardo [2] の設定による一般的な動的計画法を定義し、次に区分的動的計画法を定義する。次のような記号を使用する。

Ω = 状態空間 (注意の集合)

x = Ω の要素, $x \in \Omega$

V = Ω 上の有界な実数値関数の全体集合

v = V の要素 (費用関数と呼ぶ, $v \in V$)

V はノルム $\|v\| = \sup_{x \in \Omega} |v(x)|$ についてバナッハ空間である。

$u, v \in V$ についてもしすべての $x \in \Omega$ に対して $u(x) \leq v(x)$ ならば $u \leq v$ と書く。もし $0 \leq u \leq v$ ならば $\|u\| \leq \|v\|$ である。すなわち、ノルムは非負なる u, v について単調性を有する。各

$x \in \Omega$ について行動の集合 A_x が存在する。デカルト積 $\prod_{x \in \Omega} A_x$ を

Δ と置く。 Δ の要素 δ を政策と呼ぶ。 $\bigcup_{x \in \Omega} \{x\} \times A_x \times V$ から実数への写像 l を損失関数として定義する。通常の動的計画法 [1], [6] やマルコフ決定過程 [5], [7] において損失関数 l は次のようになっている。

$$h(x, a, v) = c(x, a) + \beta \int_{\Omega} v(y) q(dy | x, a), \quad x \in \Omega, a \in A_x, \\ v \in V.$$

ここで $c(x, a)$ は一期間の費用, β は割引因子, $q(\cdot | x, a)$ は Ω 上 $\mathcal{F}$ の推移確率である。

単調性の仮定 各 $x \in \Omega$ と $a \in A_x$ について, もし $u \leq v, u, v \in V$, ならば $h(x, a, u) \leq h(x, a, v)$ である。

縮少性の仮定 $\beta \in [0, 1)$ について

$$|h(x, a, u) - h(x, a, v)| \leq \beta \|u - v\|, \quad x \in \Omega, a \in A_x, u, v \in V, \\ \text{である。}$$

各 $\delta \in \Delta$ について V から V への写像 H_{δ} と次のように定義する。

$$(H_{\delta} v)(x) = h(x, \delta(x), v), \quad v \in V, x \in \Omega.$$

各 $v \in V$ について $H_{\bar{\delta}} v = \inf_{\delta \in \Delta} H_{\delta} v$ なる $\bar{\delta} \in \Delta$ が存在すると仮定する。この仮定が成立する十分条件を Denardo[2] は与えている。更に、 V から V への写像 H_{*} と次のように定義する。

$$(H_{*} v)(x) = \inf_{\delta \in \Delta} (H_{\delta} v)(x), \quad x \in \Omega, v \in V.$$

単調性と縮少性の仮定の下で H_{δ} と H_{*} は明らかに単調縮少写像である。動的計画法の最適方程式は, $v^{*} = \sup_{a \in A_x} h(x, a, v^{*})$ と表現される。 $v^{\delta} = H_{\delta} v^{\delta}$ と満足する v^{δ} を政策 δ の費用と呼ぶ。 $v^{*} = H_{*} v^{*}$ と満足する v^{*} を最適費用と呼ぶ。もし $\|v^{\delta} - v^{*}\| < \varepsilon$ ならば, δ は ε -最適政策である。もし $\|v - v^{*}\| < \varepsilon$ ならば,

v は ε -最適費用関数である。以上のような性質を有する動的計画法と単調縮小動的計画法と総称する。

仮定 これより以下では、すべての x について $A_x = A = \{a_1, a_2, \dots, a_p\}$ なる有限な行動空間と仮定する。

定義 1. (1) $\delta \in \Delta$ とする。もしすべての $x \in B_i, i=1, 2, \dots, m$, について $\delta(x) = a_i$ となるような Ω の分割 $P = \{B_1, B_2, \dots, B_m\}$ が存在するならば、政策 δ は区分的であると言う。

(2) $v \in V$ とする。もしすべての $x \in B_i, i=1, 2, \dots, \ell$, について $v(x) = v_i(x) \in V'$ となるような Ω の分割 $P = \{B_1, B_2, \dots, B_m\}$ と部分集合 $V' \subset V$ が存在するならば、費用関数 v は区分的であると言う。

定義 2. 次の 2 つの条件が成立するならば、単調縮小動的計画法は区分的であると言う：

- (1) もし δ と v が区分的ならば、 $H_\delta v$ は区分的である。
- (2) もし v が区分的ならば、 $H_\delta v = H_* v$ なる区分的政策 δ が存在する。

注意 Δ と V と比べて“十分小さい”部分集合 $\Delta' \subset \Delta, V' \subset V$ と考える。上の定義 2 は次のことと意味している。(1) もし $\delta \in \Delta'$ で $v \in V'$ ならば、 $H_\delta v \in V'$ である。(2) もし $v \in V'$ ならば、 $H_\delta v = H_* v$ なる $\delta \in \Delta'$ が存在する。

補助定理 1. $a \in A$ で $v \in V$ とする。もし δ が分割 P^δ に関して区

分的である。 $h(\cdot, a, v)$ が分割 P^h に関して正分的ならば、

$H_\delta v$ は積の分割 $P^\delta \otimes P^h$ に関して正分的である。

証明: $P^\delta = \{B_1, B_2, \dots, B_\ell\}$, $P^h = \{D_1, D_2, \dots, D_m\}$ とする。仮定により

$$\delta(x) = a_i, \quad x \in B_i, \quad i = 1, 2, \dots, \ell$$

$$h(x, a, v) = h_j(x, a, v), \quad x \in D_j, \quad j = 1, 2, \dots, m$$

となる。従って

$$(H_\delta v)(x) = h(x, \delta(x), v), \quad x \in \Omega$$

$$= h(x, a_i, v), \quad x \in B_i, \quad i = 1, 2, \dots, \ell$$

$$= h_j(x, a_i, v), \quad x \in B_i \cap D_j, \quad i = 1, 2, \dots, \ell,$$

$$j = 1, 2, \dots, m.$$

P^δ と P^h の積分割 $P^\delta \otimes P^h = \{B_i \cap D_j : i = 1, 2, \dots, \ell, j = 1, 2, \dots, m\}$ に関して $H_\delta v$ は正分的である。 $\square$

定理 1. もし δ と $h(\cdot, a, v)$ が正分的ならば、動的計画法は正分的である。

証明: δ と $h(\cdot, a, v)$ が正分的ならば、補助定理より $H_\delta v$ もまた正分的である。従って正分的動的計画法の定義 2 の (2) が成立することのみを証明すればよい。 $H_\delta v$ は分割 $P = \{B_i, i = 1, 2, \dots, m\}$ に関して正分的であるとする。すべての $x \in B_i$ について $(H_\delta v)(x) = h_i(x, a, v)$ である。 B_i の部分集合 G_{ij} を次のように定義する。

$$G_{ij} = \{x \in B_i : h_i(x, a_j, v) \leq h_i(x, a_k, v), \forall k \neq j\}.$$

$P_i = \{G_{ij} : j = 1, 2, \dots, p\}$ は B_i の分割であり、 $P = \bigcup_{i=1}^m P_i$ は Ω の分割となる。この部分 P に関し

$$(H_* v)(x) = h_i(x, a_j, v), \quad \forall x \in G_{ij},$$

が成立する。すべし $x \in G_{ij}$ に対し $\delta(x) = a_j$ とし定義される δ は $H_\delta v = H_* v$ なる関係を満足する。 $\square$

系. 2つの部分集合を $V' \subset V$ と $\Delta' \subset \Delta$ とする。もし $v \in V'$ ならば各 n について $H_*^n v \in V'$ である。もし $v \in V'$ で $\delta \in \Delta'$ ならば各 n について $H_\delta^n v \in V'$ である。

3. アルゴリズム

Δ と V の任意の部分集合を Δ' と V' とし、 $v_0 \geq H_* v_0$ なる $v_0 \in V'$ が与えられたとする。 $n=0$ とする。 ε -最適費用と ε -最適政策を発見するためのアルゴリズムは次のようになる。 β は縮小写像の係数である。

ステップ 1 $H_{\delta_n} v_n = H_* v_n$ なる $\delta_n \in \Delta'$ と見つけよ。

ステップ 2 もし $\|v_n - H_{\delta_n} v_n\| \leq (1-\beta)\varepsilon$ ならばステップ 4 に進め。

ステップ 3 もし $\|v_n - H_{\delta_n} v_n\| > (1-\beta)\varepsilon$ ならば、ある整数 k_n を選び $v_{n+1} = H_{\delta_n}^{k_n} v_n$ を計算せよ。 n を $n+1$ と置いしステップ 1 に戻れ。

ステップ 4 δ_n は ε -最適政策で、 v_n と $H_* v_n$ は ε -最適費用

である。

定理1とその系およびアルゴリズムの内容を整理すれば、次の定理2が得られる。

定理2. もし $v_0 \geq H_* v_0$ なる $v_0 \in V'$ が存在するならば、区分的動的計画法は ε -最適政策と ε -最適費用を持つ。

系. v_n はアルゴリズムによって生成される費用関数の系列とする。

(i) v_n は v に点収束する。

(ii) $v = H_* v$. すなわち、 v は最適費用である。

縮小写像は連続であるから系の(ii)が成立する。換言すれば、

(i), (ii)は、アルゴリズムの収束を保証する。アルゴリズムと定理における $v_0 \geq H_* v_0$ なる v_0 は、次のような場合存在する。

もし、各々の a と v について $h(\cdot, a, v) \leq 0$ ならば、 $v_0 = 0$ は $H_* v_0 = \max_a h(x, a, 0) \leq 0 = v_0$ と満足する。もし $h(x, a, v) = c(x, a) + \beta \int_{\Omega} v(y) q(dy | x, a)$ ならば、 $v_0 = \frac{M}{1-\beta}$ は $H_* v_0 \leq v_0$ と満足する。但し、 $M = \max\{|c(x, a)| : x \in \Omega, a \in A\}$ である。

4. まとめ

一般的な単調縮小動的計画法の最適政策と最適費用の正確な関数形を計算することは不可能であるけれども、それらは区分的動的計画法によって近似できることを証明した。前節で述べにわれわれのアルゴリズムは、 V' と Δ' に属する費用関

数と政策のみと取り扱えばよいことを示した。 V' と Δ' が V と Δ と比較して“大差小さい”部分集合(例えば、線形、二次形式、多項式の集合など)であるとき、アルゴリズムは一般的動的計画法の最適費用と最適政策に対して V' と Δ' の要素である費用関数と政策によって近似することを可能にしてくれる。ここで、最適政策と最適費用は必ずしも Δ' と V' の要素ではない。

アルゴリズムのステップ3において、 $k_n=1$ ならばアルゴリズムは逐次近似法に、 $k_n=\infty$ ならば政策改良法にそれぞれ相当する。従って、われわれのアルゴリズムはこの両方を特殊な場合として含んでいる。しかしながら、この k_n の最良の選択方法については、明らかではない。多分、繰返計算の初期の段階では小さい k_n を選択し、最適政策に十分近づいた段階では、大きい k_n を選ぶ方が合理的であろう。

参考文献

- [1] Blackwell, D.: Discounted Dynamic Programming. *Annals of Mathematical Statistics*, 36(1965), 226-235.
- [2] Denardo, E.V.: Contraction Mappings in the Theory Underlying Dynamic Programming, *SIAM Review* 9(1967), 165-177.
- [3] Larson, R.E.: *State Increment Dynamic Programming*, Elsevier, New York

(1968).

- [4] Sawaki, K.: Piecewise Linear Markov Decision Processes with An Application into Partially Observable Models, presented at the 1978 International Conference on Markov Decision Processes, University of Manchester (1978).
- [5] Sawaki, K. and Ichikawa, A: Optimal Control for Partially Observable Markov Decision Processes Over an Infinite Horizon, *Journal of Operations Research Society of Japan*, Vol. 21, No. 1(1978).
- [6] Strauch, R.E.: Negative Dynamic Programming, *Annals of Mathematical Statistics*, 37(1966), 871-890.
- [7] Sondik, E.J.: The Optimal Control of Partially Observable Markov Processes Over the Infinite Horizon: Discounted Costs, *Operations Research*, 26(1978), 282-304.