

数理経済学特講

複数財オークションのアルゴリズムと 離散最適化

第1回

塩浦昭義

東京工業大学 経営工学系 准教授

shioura.a.aa@m.titech.ac.jp

不可分財のオークション

- 不可分財 --- 分割できない「もの」（家，自動車，権利，など）
- 単一財の場合のオークション：よく知られている
- 複数財の場合のオークション？ ← この授業で扱う

単一財オークション

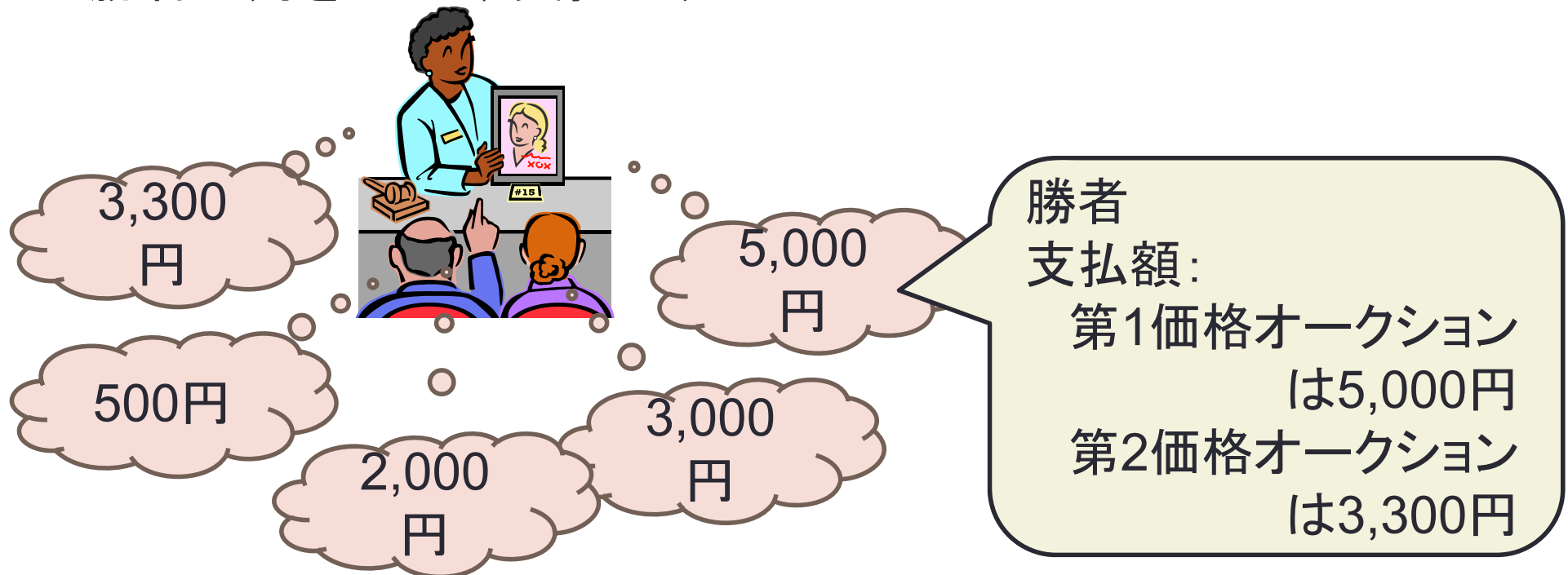
単一財オークション --- ひとつの財に対するオークション
オークションの流れ（**封印型**の場合）

1. オークションの参加者（入札者）:

品物（財）の価値を評価し、オークション主催者に伝える

2. 主催者: **勝者** および **価格（支払額）** を決定

3. 勝者: 財をもらい、支払う



複数財オークション: 単一需要モデル

複数財を **同時に** オークション

- **単一需要モデル**: 入札者は **高々1つ**の財が欲しい(**割当モデル**)
オークションの流れ (**封印型**の場合)

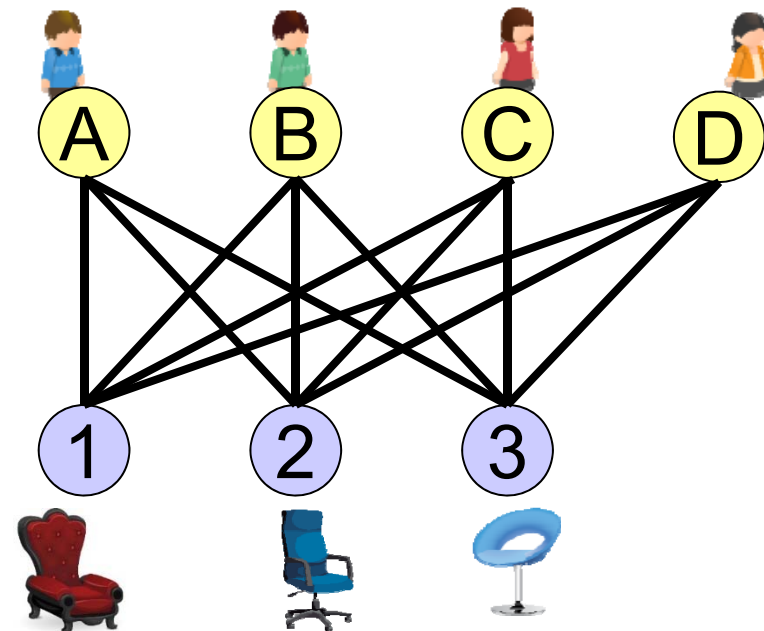
1. オークションの参加者(入札者):

各々の財の価値を評価し, オークション主催者に伝える

2. 主催者: 各々の財の **勝者** および **価格(支払額)** を決定

3. 各々の財の勝者: 財をもらい, 支払いする

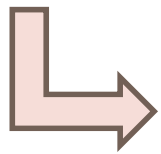
評価値	A	B	C	D
①	3	1	0	5
②	7	6	7	4
③	1	7	8	4



ワルラス均衡

複数財オークションにおける検討事項

- 入札者は, 「財の評価額 - 価格」(**利得**) を最大にしたい
- 主催者は, 財を多く売りたい
- **各々の財の勝者(割当方法)**: どの財を 誰に 割り当てるか?
- **各々の財の価格**: 各入札者の支払額 (= 割り当てられた財の価格) をどのように決めるか?



ワルラス均衡

入札者全員にとって望ましい割当 & 価格

---入札者は **利得** 最大の財をもらえる

(厳密な定義は後ほど)

この授業の目的:

- ワルラス均衡を求めるアルゴリズムの紹介
- 離散最適化の観点から理解

評価値が既知の場合のアルゴリズム

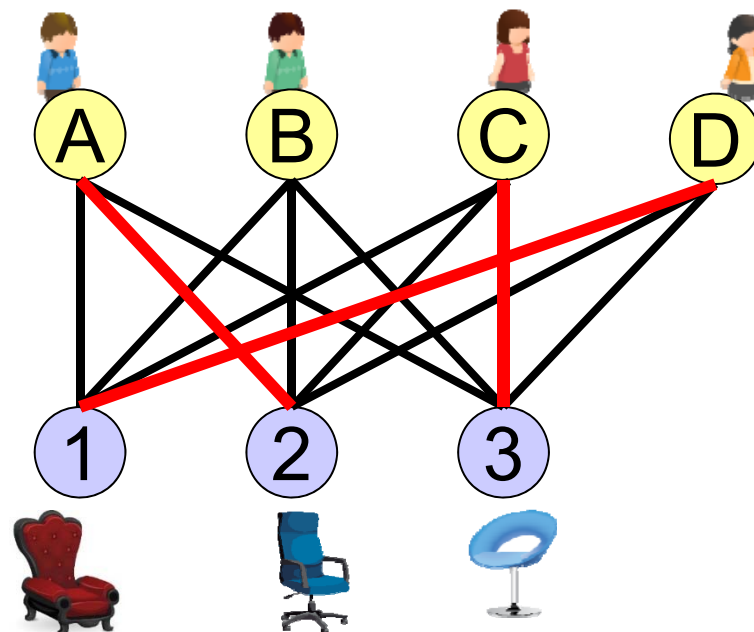
定理: ワルラス均衡における財の割当

↔ 評価値の和を最大化する財の割当

∴ 評価値が既知ならば, ワルラス均衡の割当の計算は,
最大重みマッチング問題に帰着可能

ハンガリー法(Kuhn1955)
 など, 様々なアルゴリズム

評価値	A	B	C	D
①	3	1	0	5
②	7	6	7	4
③	1	7	8	4



評価値の扱いについて

入札者の評価値は個人情報

→ オークション主催者に 直接 知らせたくない

代案: 評価値の情報を 間接的に 伝える

1. 主催者: 各財の暫定価格を決定
2. 各入札者: 暫定価格の下で最も欲しい財を報告
3. 入札者全員に(重複無く)最も欲しい財を

割当可能 → 終了. 現在の価格は均衡価格

割当不可能 → 主催者は暫定価格を適切に変更

利得最大の財

反復オークション と呼ばれる

単一財の場合 → イングリッシュ・オークション など

イングリッシュ・オークション

- ・オークション主催者: 価格を徐々に(1単位ずつ)上げる
- ・入札者: 購入可能な価格ならば挙手する
- ・購入可能なオークション参加者が1人になったら終了

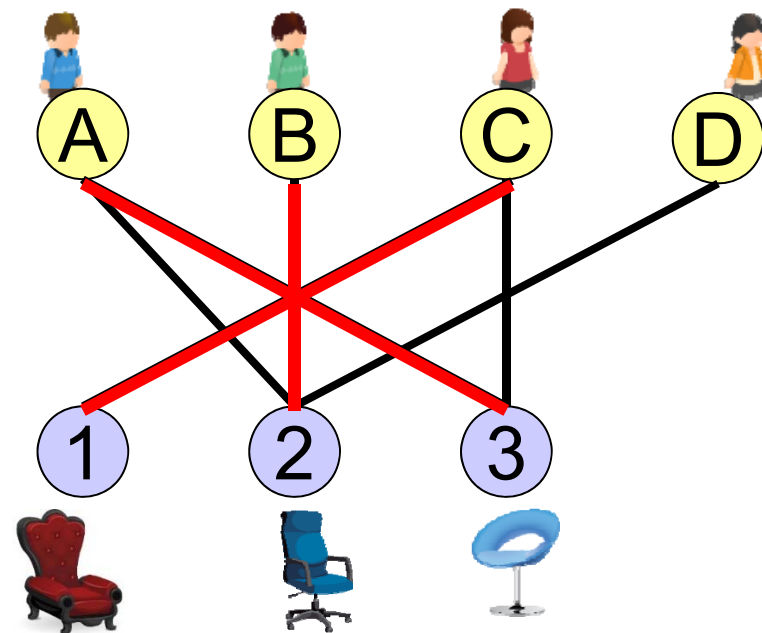
評価値を
間接的に
報告



反復オークションの検討事項その1

- 最も欲しい財(＝利得最大の財)の割当可否の判定は？
→二部グラフの **マッチング問題**へ帰着

最も 欲しい財	A	B	C	D
①			○	
②	○	○		○
③	○		○	



反復オークションの検討事項その2

- 価格の変更方法は？
 - 多くの入札者に最も欲しい財を割り当てたい
 - 基本的な方針：人気の財の価格を増加，
不人気の財の価格を減少
 - これだけでは不十分．
人気があっても価格を増やさない方がよいことも．

初期価格=(0,0)

→ 3人が両方の財を
欲しがる

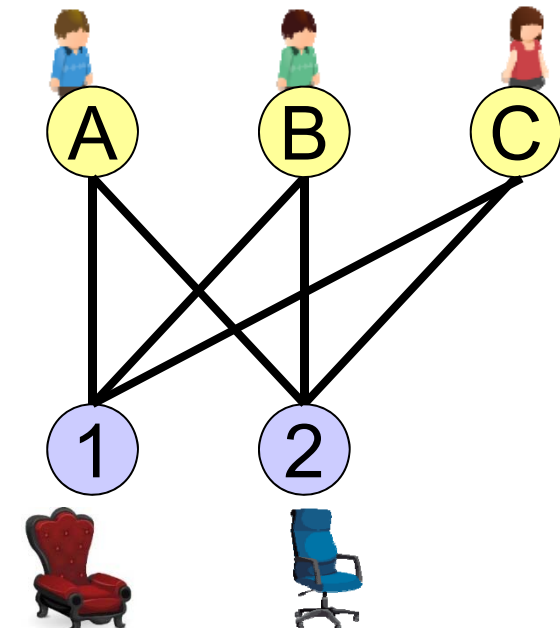
→ 価格増加 (1,1)

→ 3人が両方の財を欲しがる

→ ...

→ 価格増加 (6,6) → 誰も財を欲しがらない

評価値	A	B	C
①	5	5	5
②	5	5	5



反復オークションのアルゴリズム

以下の2つを紹介

- その1 (Bertsekas (1979), Demange, Gale, Sotomayor (1984))
 - 単調に価格を増加, **均衡割当** (および均衡価格の近似値) を求める
 - 各反復で, 入札者の最も欲しい財**ひとつ**の情報が必要
 - 価格増加のルールは簡単: 希望が重複 → 価格を増やす
- その2 (Demange, Gale, Sotomayor (1984))
 - 単調に価格を増加, **均衡価格** (および均衡割当) を求める
 - 各反復で, 入札者の最も欲しい財**すべて**の情報が必要
 - 価格増加のルールは複雑:
 - 得た情報を使い, 価格を増やす財をうまく選ぶ

今後の予定

- ワルラス均衡と最大重みマッチング問題の関係
 - 最短路問題の復習
 - 最大重みマッチングの最適性条件
 - 最大重みマッチングのアルゴリズム
 - ワルラス均衡の存在性, 最大重みマッチングとの関係
- 反復オークションのアルゴリズムの紹介
 - 最も欲しい財ひとつの情報のみを使う
 - 最も欲しい財すべての情報を使う
- より一般的なオークションにおける均衡価格の計算

ワルラス均衡の定義

ワルラス均衡の定義：準備

$N = \{1, 2, \dots, n\}$ 財の集合（各財の在庫は1つのみ）



$B = \{1, 2, \dots, m\}$ 入札者の集合



$v(i, j) \in \mathbb{R}_+$ 入札者 i の 財 j に対する評価額（非負の実数値）

$\alpha(i) \in N \cup \{0\}$ 入札者 i への財の割当

ただし、財が割り当てられていないとき、 $\alpha(i) = 0$

仮定： $\alpha(i), \alpha(i') \in N$ ならば $\alpha(i) \neq \alpha(i')$

$p(j) \in \mathbb{R}_+$ 財 j の価格（非負の実数値）

ダミーの財
と見なす

ワルラス均衡

定義: 財の割当 $\alpha(i) \in N \cup \{0\}$ および財の価格 $p(j) \in \mathbb{R}_+$
は **ワルラス均衡 (競争均衡)**

↔ 以下の条件を満たす

- 入札者 i に財 j が割り当てられる ($\alpha(i) = j$)
→ $0 \leq v(i, j) - p(j) = \max_{1 \leq h \leq n} \{w(i, h) - p(h)\}$
- 入札者 i に財の割り当てがない ($\alpha(i) = 0$)
→ $\max_{1 \leq h \leq n} \{w(i, h) - p(h)\} \leq 0$
- 財 j が誰にも割当られない → $p(j) = 0$

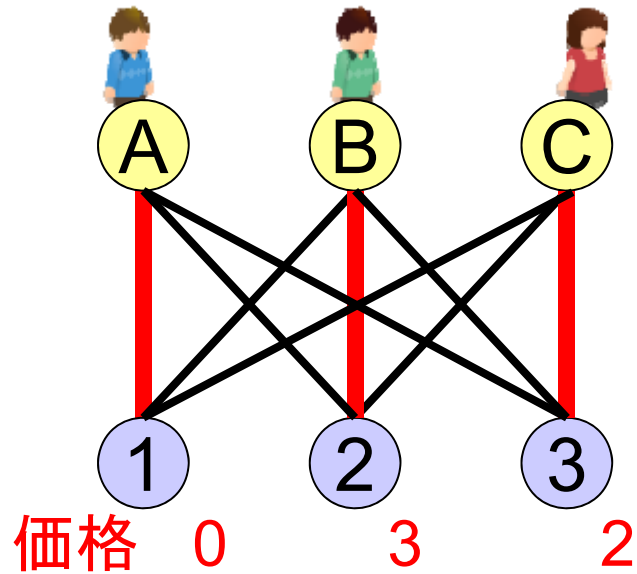
利得最大の財
が割り当て

どの財も
欲しくない

価格 > 0 の
財は
皆売れる

- 定義: **均衡割当** = 均衡に現れる割当
均衡価格 = 均衡に現れる価格

オークションと均衡の具体例



$v(i,j)$	A	B	C
①	3	1	1
②	6	5	3
③	2	4	4

価格	利得	A	B	C
0	①	3	1	1
3	②	3	2	0
2	③	0	2	2

ワルラス均衡の書き換え

- 入札者 i に財 j が割り当てられる ($\alpha(i) = j$)
 $\rightarrow 0 \leq v(i, j) - p(j) = \max_{1 \leq h \leq n} \{w(i, h) - p(h)\}$
- 入札者 i に財の割り当てがない ($\alpha(i) = 0$)
 $\rightarrow \max_{1 \leq h \leq n} \{w(i, h) - p(h)\} \leq 0$
- 財 j が誰にも割り当てられない $\rightarrow p(j) = 0$

$v(i, 0) = 0, p(0) = 0$ とおく $\rightarrow$ 条件を簡略化できる

- $\forall i \in M: v(i, \alpha(i)) - p(\alpha(i)) = \max_{0 \leq h \leq n} \{w(i, h) - p(h)\}$
- 財 j が誰にも割り当てられない $\rightarrow p(j) = 0$

演習問題

下記のように評価値が与えられたときのワルラス均衡を求めよ。
ただし, A,B,C,...は入札者, ①, ②, ③, ... は財を表す.

問1

$v(i,j)$	A	B	C
①	2	3	6
②	6	7	7

問2

$v(i,j)$	A	B	C
①	3	1	0
②	7	6	7
③	1	7	8

問3

$v(i,j)$	A	B	C
①	3	1	0
②	7	6	7
③	1	7	8
④	0	0	4