

I Verkehr und Flüsse

§1 Das Basismodell für statischen Verkehr

1.1 Grundlagen

Rushhour \Rightarrow statisches Bild für einige Stunden

\Rightarrow Standardflussmodelle anwendbar

$x_a =$ Flussmenge / Zeiteinheit auf Kante (arc) a

Digraph $G = (V, A)$ modelliert Straßennetz $A =$ arcs
($|A| \approx 30.000$ in Berlin)

Start-Ziel Knotenpaare (s_k, t_k) $k \in C$ ("Commodities")

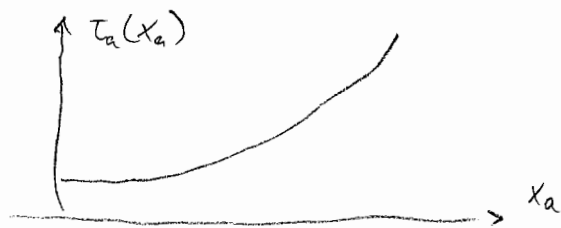
mit Demand $d_k =$ Flussmenge

Fluss zwischen s_k, t_k kann sich beliebig aufteilen

(stetiger Fall, sinnvoll wenn d_k groß)

Interaktion zwischen verschiedenen (s_k, t_k) durch Congestion (Stau)

Fluss x_a auf Kante a verursacht eine flussabhängige Fahrzeit $\tau_a(x_a)$



(Latency, Latenz)

meist vorausgesetzt als stetig, streng monoton \nearrow

z.B. Bureau of Public Roads

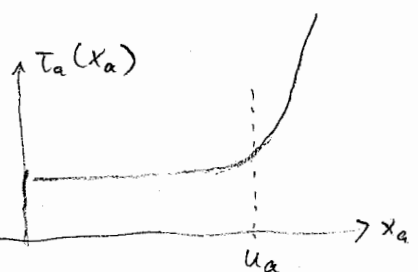
$$\tau_a(x_a) := \tau_a^0 \cdot \left(1 + \alpha \left(\frac{x_a}{u_a} \right)^\beta \right)$$

free flow

travel time

$u_a =$ practical

"capacity"



$\beta = 4$

$\alpha = 0,15$

? typische
Werte

Flüsse (s_k, t_k) darstellbar als Kantfluss $x^A = \begin{pmatrix} \text{Fluss auf Kante 1} \\ \dots \\ 2 \\ \vdots \\ \dots \\ m \end{pmatrix}$

oder Pfadfluss $x^P = \begin{pmatrix} \text{Fluss auf Weg 1} \\ \vdots \\ \text{Weg P} \\ \text{Kant 1} \\ \vdots \\ \text{Kant q} \end{pmatrix} \quad p+q \leq m \text{ per commodity}$

im Verkehr wollen wir Wege / Routen finden

\Rightarrow Flüsse meist als Pfadfluss berechnen und erzeugen

\Rightarrow Pfaddarstellung hat keine Kante

$P_k =$ Menge der (s_k, t_k) Pfade (o.B.d.A paarw. disjunkt)

$$P = \bigcup_k P_k$$

Ein Pfadfluss x ist zulässig

$$\Leftrightarrow \sum_{P \in P_k} x_P = d_k \quad \text{demand wird erfüllt}$$

$$x_P \geq 0$$

"Kosten" $C(x)$ eines Pfadflusses:

$$= \sum_{a \in A} x_a \cdot \tau_a(x_a) \quad \text{Gesamtfahrzeit (Netzbelastung)}$$

$$= \sum_{P \in P} x_P \left(\underbrace{\sum_{a \in P} \tau_a(x_a)}_{\tau_P(x)} \right)$$

$\tau_P(x)$ Fahrzeit entlang Pfad P

denn:

$$x_a = \sum_{P \ni a} x_p$$

$$\sum_{a \in A} \left(\underbrace{\sum_{P \ni a} x_p}_{x_a} \right) \tau_a(x_a) = \sum_P \underbrace{\sum_{a \in P} \tau_a(x_a)}_{\tau_P(x)}$$

Bemerkung: können Kosten auch bzgl. allgemeinerer
Kantenkosten $c_a(x_a)$ genauso ermitteln: Konvex

$$C(x) := \sum_{a \in A} c_a(x_a)$$

in unserem Fall ist $c_a(x_a) = x_a \cdot \tau_a(x_a)$

Sehen generell voraus, dass $x_a \cdot \tau_a(x_a)$ Konvex ist

1.2 Das Systemoptimum

Problem SO: $\min C(x)$
 unter $\sum_{P \in \mathcal{P}_k} x_P = d_k$ für alle $k \in C$
 $x_P \geq 0$

Ein optimales Fluss (Systemoptimum) wird mit f^* bezeichnet

Formulierung hat exponentiell viele Variable

ABER: Knotenformulierung hat nur n Variable
 aus Knotenfluss mit Kosten $C(x)$ kann durch
 Pfaddekomposition ein Pfadfluss mit gleichen Kosten
 konstruiert werden

\Rightarrow bei konvexer Zielfkt $C(x)$ kann SO mit
 der Ellipsoidmethode in polynomiales Zeit gelöst werden

\Rightarrow SO $\in P$

(bis auf additives ϵ)

↳ da Nebenbedingungen polynomial
 separierbar

SO aus nichtlinearer Sicht:

konvexes separables nichtlin. Opt. Problem mit linearen Nebenbed

$$\hookrightarrow C(x) = \sum_{P \in \mathcal{P}} x_P \cdot c_P(x) \text{ separabel nach Variablen}$$

konvex \Rightarrow lokales Optimum = globales Optimum

Optimalitätsbedingungen der nichtlinearen Optimierung:

(first order conditions, Karu-Tucker-Bedingungen)

ergeben:

1.1. Lemma: (Optimalitätsbedingungen für SO)

Seien die $c_a(x_a)$ konvex und differenzierbar

Dann ist ein Fluss f^* optimal in SO

$$\Leftrightarrow c'_p(f^*) \leq c'_q(f^*) \quad \text{für alle } k \in C \text{ und alle Pfade } P, Q \in \mathcal{P}_k \\ \text{mit } f^*_p > 0$$

$$\text{mit } c'_p(f^*) := \sum_{a \in P} \frac{d}{dx_a} c_a(x_a) = \sum_{a \in P} c'_a(x_a)$$

Speziell für $c_a(x_a) = x_a \cdot \tau_a(x_a)$ ergibt sich

$$c'(x_a) = \tau_a(x_a) + x_a \cdot \tau'(x_a)$$

Bemerkung:

① Beweisidee: (später genauer)

Fluss f^* ist lokal optimal (reicht zu zeigen)

\Leftrightarrow Verlagerung von Fluss auf einen anderen Pfad erhöht die Kosten

\Leftrightarrow marginaler "Gewinn" für Verringerung von Fluss entlang Pfad $P \in \mathcal{P}_k$
 \leq marginale Kosten für Vergrößerung von Fluss entlang anderen Pfad $Q \in \mathcal{P}_k$

$$\Leftrightarrow c'_p(f^*) \leq c'_q(f^*) \dots$$

② Interpretation im Falle $c_a(x_a) = x_a \cdot \tau_a(x_a)$

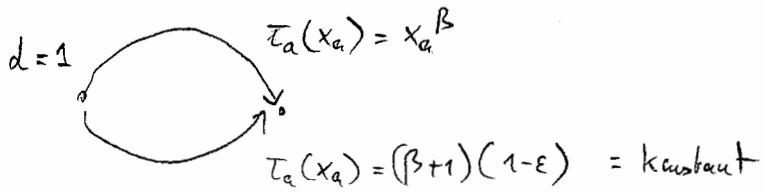
$$c'(x_a) = \underbrace{\tau_a(x_a)}_{\text{Fahrt auf Kante}} + \underbrace{x_a \cdot \tau'(x_a)}_{\text{"externe" Kosten}} = \text{marginale Kosten}$$

Fahrt
auf Kante

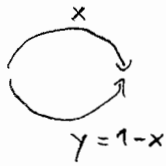
"externe" Kosten
die Nutzer für andere Nutzer verursachen
bei Nutzer der Kante a

Systemoptimum kann zu anderen Individuallösungen führen

Pigou's Beispiel



Optimalitätsbed. für SO bzgl. Fluss $\begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$



$$\frac{d}{dx} (x \cdot x^\beta) = \frac{d}{dy} (\beta+1)(1-\epsilon)y$$

$$(\beta+1)x^\beta = (\beta+1)(1-\epsilon)$$

$$\Rightarrow x^\beta = 1-\epsilon \quad \Rightarrow x = \sqrt[\beta]{1-\epsilon} < 1 \quad \Rightarrow y > 0$$

\Rightarrow im Systemoptimum folgendes Bild:

Faktor oben: $\tau_a(x_a) = \left(\sqrt[\beta]{1-\epsilon}\right)^\beta = 1-\epsilon < 1 \quad \forall \beta$

Faktor unten: $(\beta+1)(1-\epsilon) \rightarrow \infty$ für $\beta \rightarrow \infty$

"Einige" ($y > 0$) werden geopfert für das Gemeinwohl!

1.3 Das Nutzergleichgewicht (User Equilibrium)

Nutzer sind eigennützig, suchen für sich den schnellsten Weg

Ein ^{zul.} Fluss f ist im Wardrop Equilibrium (Wardrop 1952)

$\Leftrightarrow \tau_p(f) \leq \tau_Q(f)$ für alle $k \in C$ und alle Pfade
 $P, Q \in P_k$ mit $f_p > 0$

Nash führte 1951 allgemeine Gleichgewichte für nicht-köoperative Spiele ein

In unserer Situation bedeutet dies:

Ein zulässiger Fluss ist im Nash-Gleichgewicht (User Equilibrium, UE)

\Leftrightarrow Kein Nutzer kann sich durch Wahl eines anderen Pfades verbessern (wenn alle anderen gleich bleibt)

\Leftrightarrow für alle $k \in C$ und alle $Q, R \in P_k$ mit $f_Q > 0$

und für alle $0 \leq \varepsilon \leq f_Q$ gilt:

der Fluss f^ε definiert durch

$$f_p^\varepsilon := \begin{cases} f_Q - \varepsilon & \text{für } P = Q \\ f_R + \varepsilon & \text{für } P = R \\ f_P & \text{sonst} \end{cases} \quad \begin{array}{l} \varepsilon \text{ Fluss geht} \\ \text{von } Q \text{ auf } R \end{array}$$

erfüllt $\tau_Q(f) \leq \tau_R(f^\varepsilon)$

1.2 Lemma: (UE = Wardrop Equilibrium)

Sind alle $\tau_a(x_a)$ stetig und schwach monoton, so gilt für jeden

zulässigen Fluss f :

f ist im UE $\Leftrightarrow f$ ist im Wardrop Equilibrium

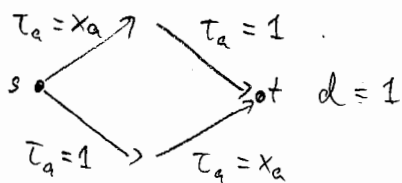
Beweisidee: Grenzübergang $\epsilon \rightarrow 0$ \square

Bemerkung: keine der beiden Voraussetzungen kann fallengelassen werden = Aufgabe 1.1

Nachteile des User Equilibrium:

- 1) nicht optimal im Sinne des SO
- 2) keine Konvergenz (d.h. mehr Straßen \neq geringere Gesamtfahrzeit)

1.3 Beispiel (Braess Paradox)

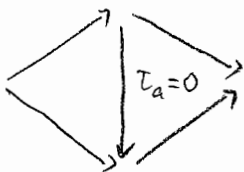


UE: schicke $\frac{1}{2}$ entlang beider Pfade

$\Rightarrow \tau_p(x) = \frac{3}{2}$ auf jedem Pfad

$$\Rightarrow C(x) = \sum_P \tau_p(x) \cdot x_p = \frac{1}{2} \cdot \frac{3}{2} + \frac{1}{2} \cdot \frac{3}{2} = \frac{3}{2}$$

Bau eine neue schnelle Straße



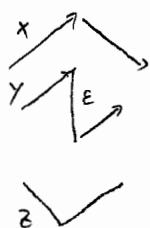
UE: schicke 1 entlang

$\Rightarrow \tau_p(x) = 2$ auf diesem Pfad

$$\Rightarrow C(x) = 2 > \frac{3}{2}$$

$$C(SO) \leq \frac{3}{2} \Rightarrow \text{UE nicht optimal}$$

Genauer Wert des SO: (unter Annahme, dass $\tau_a = \epsilon$ auf der neuen Straße)



Opt. Bed. \Rightarrow Gleichheit der marginalen Kosten auf flusssparenden jedem Pfad

$$\rightarrow \frac{d}{d(x+y)} (x+y)^2 + \frac{d}{dx} (x \cdot 1)$$

$$\rightarrow \frac{d}{d(x+y)} (x+y)^2 + \frac{d}{dy} (y \cdot \epsilon) + \frac{d}{d(y+z)} (y+z)^2$$

$$\rightarrow \frac{d}{dz} (z \cdot 1) + \frac{d}{d(y+z)} (y+z)^2$$

$$\Rightarrow 2(x+y) + 1 = 2(x+y) + \varepsilon + 2(y+z) = 1 + 2(y+z)$$

①
②
③

① = ③ $\Rightarrow x = z$

② = ② $\Rightarrow 1 = \varepsilon + 2(y+z) \stackrel{x=z}{=} 2x = 1 - \varepsilon - 2y$ ④

$x+y+z = 1 \stackrel{x=z}{=} 2x = 1-y$ ⑤

④, ⑤ $\Rightarrow 1 - \varepsilon - 2y = 1 - y \Rightarrow y = -\varepsilon$

Widerspruch zu $y \geq 0$ falls $\varepsilon > 0$

\Rightarrow entlang Weg \downarrow fließt kein Fluss \Rightarrow nicht in Optimalitätsbedingung!

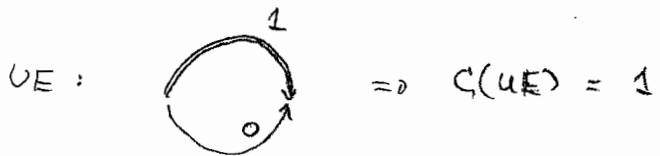
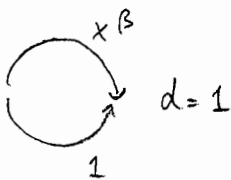
$\Rightarrow x = z = \frac{1}{2}$ $y = 0 \Rightarrow$ neue Straße wird (auch bei $\varepsilon > 0$) im Systemoptimum nicht genutzt

Messung, wie sich UE und SO unterscheiden

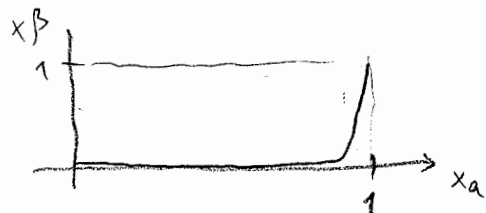
Preis des Anarchy $:= \frac{C(UE)}{C(SO)}$

1.4 Beispiel (Pigou)

Der Preis des Anarchy kann (bei beliebigen τ_a) beliebig groß werden.



β groß $\Rightarrow x^\beta$ hat die Gestalt



\Rightarrow Fluss



hat Kosten $(1-\varepsilon) \underbrace{(1-\varepsilon)^\beta}_{\approx 0 \text{ für } \beta \text{ groß}} + \underbrace{\varepsilon \cdot 1}_{\approx 0 \text{ für kleingesetztes } \varepsilon}$

$\rightarrow \varepsilon$ für $\beta \rightarrow \infty$

$\Rightarrow \frac{C(UE)}{C(SO)} \geq \frac{1}{\varepsilon} \Rightarrow$ wird beliebig groß

(allerdings bei sehr steilen Faktorproduktfunktionen!)

Frage: Wie groß ist der Preis der Maschine bei vernünftigen Faktorproduktfunktionen?

1.4 Beziehungen zwischen UE und SO

Basisbeziehung folgt aus Lemma 1.1 und der Definition des UE

Lemma 1.1 f^* ist SO $\Leftrightarrow c'_p(f^*) \leq c'_q(f^*) \quad \forall k, \forall P, Q \in \mathcal{P}_k$ mit $f_p > 0$

Def UE f ist UE $\Leftrightarrow \tau_p(f) \leq \tau_q(f) \quad -''-$

↓

1.5 Proposition (Beckmann, McGuire & Winstan 1956)

Sei f^* ein zulässiges Fluss für eine Instanz mit konvexen, differenzierbaren, schwach monoton steigenden Fahrzeitfkt. $\tau_a(x_a)$. Dann gilt:

f^* ist SO bzgl. $\tau_a(x_a) \Leftrightarrow f^*$ ist UE bzgl. $c'_a(x_a) = \tau_a(x_a) + x_a \tau'_a(x_a)$

Interpretation:

(1) SO ist UE bzgl. der marginalen Kosten $c'_a(x_a)$ als Fahrzeitfkt

(2) UE ist SO bzgl. der Fahrzeitfkt. $\frac{1}{x_a} \int_0^{x_a} \tau_a(t) dt =: \hat{\tau}_a(x_a)$

denn: $\frac{d}{dx_a} (x_a \cdot \hat{\tau}_a(x_a)) = \tau_a(x_a) \quad \Rightarrow$ Opt Bed für SO für $\hat{\tau}$
 $\hat{\tau} \triangleq$ Wardrop Bed für τ

\Rightarrow UE ist SO bzgl. Kostenfkt $C(x) = \sum_{a \in A} \int_0^{x_a} \tau_a(t) dt$ (Beckmann Transformation)

1.6 Folgerung

(1) Unter den Voraussetzungen von Prop. 1.5 ist das UE f eindeutig als Kantfluss bestimmt

(2) Für alle Pfade $P, Q \in \mathcal{P}_k$ mit $f_p, f_q > 0$ gilt

$$\tau_p(f) = \tau_q(f) =: L_k(f)$$

[alle Fluss führender (s_k, t_k) Wege haben dieselbe Fahrzeit]

(3) UE und SO können mit denselben Methoden berechnet werden

Beweis:

$$u(1): \text{ UE ist SO bzgl. } \sum_a \int_0^{x_a} \tau_a(t) dt =: \hat{C}(x)$$

streng monoton, diffbar, konvex

 \Rightarrow UE ist Optimum einer konvexen, separablen, streng monotonen Fkt \Rightarrow eindeutiges Optimumu(2) folgt aus Def des Wardrop Equilibrium \square

1.7 Folgerung (Kantengebühren)

Prop. 1.5 ist Basis für Straßenzölle (im Prinzip)

Wenn man ein SO bzgl. τ_a erzielen will, so muss man durch Kant die "Kosten" pro Kante zu $\tau_a(x_a) + x_a \tau'(x_a)$ verändern

$\underbrace{\tau_a(x_a)}_{\text{Zoll}} + \underbrace{x_a \tau'(x_a)}_{\text{Kant}}$
 gleichgewichtet

Für die weiteren Überlegungen ist folgende Technik nützlich:

Sei f ein zulässiger, fester Fluss.Die Kosten eines zulässigen Flusses x relativ zu Fahrzeugen bzgl. f

$$\text{sind } C^f(x) := \sum_{a \in A} x_a \cdot \tau_a(f_a)$$

\uparrow Flussmenge bzgl. x \uparrow Fahrzeug bzgl. f

1.8 Proposition (Smith 1979, Dafermos 1980)

 f sei zulässig für eine Instanz mit stetigen, schwach monotonen τ_a .

Dann gilt:

$$f \text{ ist UE} \iff C^f(f) \leq C^f(x) \text{ für alle zulässigen Flüsse } x$$

Interpretation: UE f minimiert die relativen Kosten $C(f(x)) \quad \forall x$

Beweis: " \Rightarrow "

$$f \text{ UE} \Rightarrow \tau_P(f) = L_k(f) \quad \text{für alle } P \in P_k \text{ mit } f_P > 0$$

$$\tau_Q(f) \geq L_k(f) \quad Q \in P_k \text{ mit } f_Q = 0$$

Für einen beliebigen Fluss x gilt dann $d_k = \sum_{Q \in P_k} x_Q = \sum_{P \in P_k} f_P$

$$C^f(f) = C(f) = \sum_k \sum_{\substack{P \in P_k \\ f_P > 0}} L_k(f) \cdot f_P = \sum_k \sum_{\substack{Q \in P_k \\ x_Q > 0}} L_k(f) x_Q \quad (*)$$

$$\leq \sum_k \sum_{\substack{Q \in P_k \\ x_Q > 0}} \tau_Q(f) \cdot x_Q = C(f(x))$$

" \Leftarrow "

$C^f(f) \leq C(f(x))$ nach Voraussetzung \forall zul. Flüsse x

Annahme: f kein UE

$$\Rightarrow \exists k, Q, R \in P_k \text{ mit } f_Q > 0 \text{ und } \tau_Q(f) > \tau_R(f)$$

Sei x der Fluss, der aus f entsteht, indem alle Fluss von Q auf den Weg R geschickt wird

$$\Rightarrow C^f(f) - C^f(x) = \tau_Q(f) \cdot f_Q - \tau_R(f) \cdot f_Q$$

$$= (\tau_Q(f) - \tau_R(f)) f_Q > 0$$

$$\Rightarrow C^f(f) > C^f(x), \text{ Widerspruch } \square$$

1.9 SATZ (Roughgarden & Tardos 2002)

Für affin lineare Faktortfunktionen $T_a(x_a) = \alpha_a \cdot x_a + \beta_a$ gilt $\frac{UE}{SO} \leq \frac{4}{3}$

Ist $\beta_a = 0$ für alle a , so ist $\frac{UE}{SO} = 1$

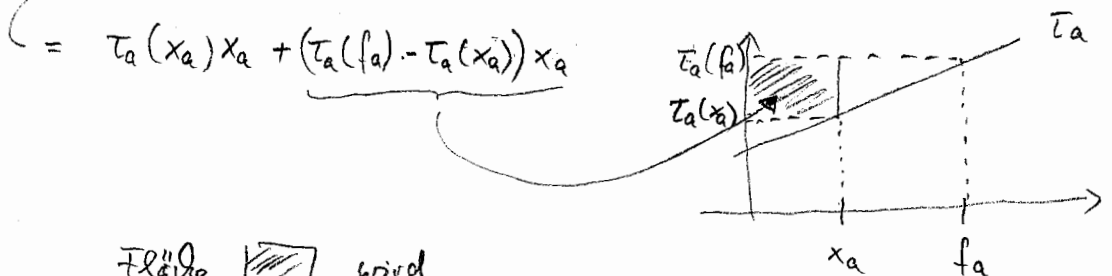
Beweis (Schulz & Stier 2004)

(1) Sei f ein UE Fluss und x ein beliebiger zulässiger Fluss

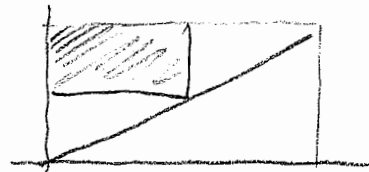
$$\text{Prop. 1.8} \Rightarrow C(f) = C^f(f) \leq C^f(x) = \sum_{a \in A} \tau_a(f_a) x_a$$

$$= \sum_{\substack{a \in A \\ x_a < f_a}} \tau_a(f_a) x_a + \sum_{\substack{a \in A \\ x_a \geq f_a}} \tau_a(f_a) x_a$$

$\leq \tau(x_a) \cdot x_a$ wegen Monotonie von τ



Fläche wird
am größten in folgender
Situation



$$\Rightarrow \text{Fläche} \leq \frac{1}{4} \cdot \tau_a(f_a) \cdot f_a = \frac{1}{4} \text{Fläche}$$

$$\Rightarrow C(f) \leq \sum_{a \in A} \tau_a(x_a) x_a + \frac{1}{4} \sum_{a \in A} \tau_a(f_a) \cdot f_a = C(x) + \frac{1}{4} C(f)$$

$$\Rightarrow \frac{3}{4} C(f) \leq C(x) \Rightarrow C(f) \leq \frac{4}{3} C(x) \text{ für jeden zulässigen Fluss,}$$

speziell für das Systemoptimum

Braess Paradox ergibt: $\frac{UE}{SO} = \frac{2}{3/2} = \frac{4}{3} \Rightarrow$ Schwanke ist schlaf

↑
affin lineare Faktoren f_{kt}

Beweis zeigt außerdem $C^f(x) \leq C(x) + \frac{1}{3} C(f)$ (1.1)

(2) Sei $\tau_a(x_a) = \alpha_a \cdot x_a$, d.h. $\beta_a = 0 \forall a$

Optimalitätskriterium für SO f^* :

$$\tau'_p(f^*) \leq \tau'_q(f^*) \quad \forall k \quad \forall P, Q \in \mathcal{P}_k \text{ mit } f_p^* > 0 \quad (1)$$

$$\underbrace{\sum_{a \in P} 2\alpha_a x_a}_{\tau'_p(f^*)} \leq \underbrace{\sum_{a \in Q} 2\alpha_a x_a}_{\tau'_q(f^*)} \quad \dots$$

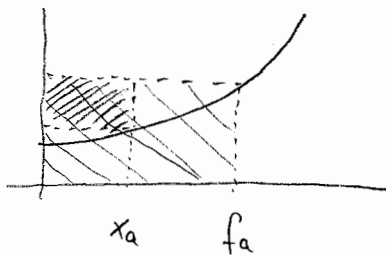
Wardrop Bedingung für UE

$$\tau_p(f) \leq \tau_q(f) \quad \forall \dots$$

$$\underbrace{\sum_{a \in P} \alpha_a x_a}_{\tau_p(f)} \leq \underbrace{\sum_{a \in Q} \alpha_a x_a}_{\tau_q(f)} \quad \forall \dots \quad (2)$$

offenbar sind (1) und (2) äquivalent \square

Verallgemeinerung auf allgemeine Fahrzeitfunktionen:



made möglichst groß \rightarrow ^{max}

=> im Beweis ist



=>

$$\Rightarrow UE \leq SO + \left(\frac{\text{max}}{\text{max}} \right) UE$$

$$\Rightarrow \frac{UE}{SO} \leq 1 / \left(1 - \frac{\text{max}}{\text{max}} \right)$$

Aufgabe 2: Berechne den Preis der Nachfrage für quadratische/kubische/Grad 4 Polynome als Fahrzeitfunktion (mit Koeffizienten ≥ 0)

1.10 SATZ (Roughgarden & Tardos 2002)

$$C(UE) \leq C(SO \text{ für den doppelten demand})$$

positive Interpretation:

Netzbelastung im UE ist beschränkt (durch die optimale Netzbelastung für den doppelten Bedarf)

negative Interpretation:

in den Kosten des UE kann optimal nur bis zum doppelten demand gerundet werden

Verwandtes Resultat

1.11 SATZ (Correa, Schulz, Steier 2005)

$$C(UE) \leq C(SO \text{ für den } (1+\beta)\text{-fachen demand})$$

$$\text{mit } \beta = \frac{\text{max}}{\text{min}}$$


$\beta \leq 1 \Rightarrow$ Satz 1.11 impliziert Satz 1.10

Ist aber im Einzelfall sogar deutlich schärfer

z.B. affin-lineare Fahrzeitfunktionen $\Rightarrow \beta = \frac{1}{4}$

$\Rightarrow C(UE) \leq C(SO \text{ für den } \frac{5}{4}\text{-fachen demand})$

Beweis Satz 1.11

Sei f Fluss im UE, x optimaler Fluss für $(1+\beta)$ -fachen demand

Betrachte Fluss y mit $y_a := \frac{1}{1+\beta} x_a$

$\Rightarrow y$ ist Fluss zum demand d , genauso wie f

$$\Rightarrow \text{(Prop 1.8)} \quad C(f) \leq C^f(y) = \sum_{a \in A} \tau_a(f) \cdot y_a = \frac{1}{1+\beta} C^f(x)$$

$$\Rightarrow (1+\beta) C(f) \leq C^f(x) = \sum_{a \in A} \tau_a(f) x_a = \frac{1}{1+\beta} \sum_a \tau_a(f) x_a =$$

$$\leq C(x) + \beta C(f)$$

↑

Beweis von Satz 1.9

für allgemeine Kostenfkt.

(1.1)

$$\Rightarrow C(f) \leq C(x) \quad \square$$

Aufgabe 1.3

Verschiebung der Ableitung $\frac{UE}{SO} \leq \frac{1}{1-\beta}$

für den Fall $\tau_a(0) \geq \delta \tau_a(x_a)$
 ↑ UE flow



Berücksichtige δ im Preis der Nachfrage

(i) allgemein

(ii) bei der BPR-Funktion