

ДИНАМІЧНА ПОБУДОВА ГІЛОК НА ОСНОВІ НЕЛІНІЙНИХ ОЦІНОК У МЕТОДІ ГІЛОК ТА МЕЖ

Вступ. Підхід до цілочисельної та комбінаторної оптимізації на основі ідеї гілок та меж веде до широкого класу алгоритмів, що дають можливість розв'язувати трудні задачі або точно, або в межах деяких обґрунтованих оцінок. Ці методи існують у різних видах та формах.

Використання такого підходу є доцільним, коли пошук оптимального розв'язку прямими методами є складною проблемою як в теоретичному сенсі, так і в сенсі необхідного об'єму розрахунків для задач з конкретними даними.

Багато робіт з використання таких методів присвячені розв'язку задач із розміщення виробництва [1, 2]. Також цей метод застосовується до багатьох типів комбінаторних задач – багаторівневого розміщення виробництва [3], задач кластеризації [4], задачі комівояжера [5], задач з дисконтами [6], задачі k -центрів [7], задачі побудови розкладів для машин [8].

Для розв'язання оптимізаційної задачі методом меж та гілок на деякій допустимій множині рішень Ω мають виконуватися такі загальні властивості задачі.

Множина допустимих розв'язків може бути задана ефективно (скажімо, системою обмежень «помірної» кількості).

Для певних підмножин допустимої множини мають «легко» розраховуватися нижні L та верхні U межі по цільовій функції та нижні x_L та верхні x_U границі для змінних.

Ми розглядатимемо задачу пошуку ε -мінімального значення цільової функції $f(x, y)$ на допустимій множині, що визначається умовами $g(x, y) \leq 0$, $x \in \Omega$. Тут x та y – вектори багатовимірних просторів, умова $g(x, y) \leq 0$ – узагальнене обмеження з неперервною функцією $g(\cdot, \cdot)$, а множина Ω визначає дискретну (комбінаторну) природу задачі через вектор змінних x . Вектор y є вектором неперервних змінних, які не обов'язково мають бути в задачі.

Запропоновано спосіб динамічної побудови дерева розгалуження у методі гілок та меж, що означає зміну кореневої вершини та порядку інших вершин у процесі пошуку. Також запропоновано використання нелінійних оцінок. Такі зміни призводять до підвищення ефективності методу гілок та меж.

Ключові слова: методі гілок та меж, дерево розгалуження, нелінійні оцінки, динамічне дерево.

Пошук ε -мінімального значення означає, що ми шукаємо таку допустиму пару векторів $(x_\varepsilon, y_\varepsilon)$, що $f(x_\varepsilon, y_\varepsilon) \leq \min\{f(x, y) \mid g(x, y) \leq 0, x \in \Omega\} + \varepsilon, \varepsilon \geq 0$.

Загальна схема застосування методу гілок та меж для цієї задачі. Початкову допустиму множину Ω назвемо допустимою множиною рівня 0 і позначимо Ω^0 . Рівень 0 назвемо найвищим. Цільовій функції найкращого припустимого розв'язку дамо значення $f_R = \infty$, якщо такого розв'язку ще немає, або скінчене значення, якщо якийсь розв'язок є.

Метод починає працювати з рівня 1, послідовно розбиваючи допустимі множини верхніх рівнів Ω^{r-1} на підмножини нижчих рівнів Ω_i^r . Виконуються такі кроки:

1) розбиття поточної допустимої підмножини Ω^{r-1} на k_r підмножин (як правило дві), що не перетинаються: $\Omega^{r-1} = \bigcap_{i=1}^{k_r} \Omega_i^r, \Omega_i^r \cap \Omega_j^r = \emptyset, \forall i \neq j, i, j = 1, \dots, k_r, \Omega_i^r \neq \emptyset, i = 1, \dots, k_r$;

2) розрахунок нижніх L_i^r та верхніх U_i^r оцінок розв'язку задачі на підмножинах $\Theta_i^r = \{g(x, y) \leq 0, x \in \Omega_i^r\}, i = 1, \dots, k_r$. Якщо $\Theta_i^r = \emptyset$, то призначимо $L_i^r = U_i^r = \infty$;

3) оновлення рекордного (найкращого для знайдених припустимих розв'язків задачі) значення цільової функції $f_R = \min\{f_R, U_1^r, U_2^r, \dots, U_{k_r}^r\}$;

4) вибір підмножини $\Omega_{i_r}^r$ для подальшого розбиття серед тих, які можна розбити та для яких $L_{i_r}^r + \varepsilon < f_R, i = 1, \dots, k_r$;

5) якщо така множина є, то перехід на крок 1 на наступному рівні $r+1$ для множини $\Omega_{i_r}^r$. Якщо такої множини немає, то перехід на крок 4 з поверненням на рівень $r-1$ і уточнення нижньої оцінки для множини $\Omega_{i_{r-1}}^{r-1}: L_{i_{r-1}}^{r-1} = \min_{i=1, \dots, k_r} L_i^r$;

6) припинення роботи, якщо $r-1=0$.

При досить простій формальній схемі методу його реалізація потребує конкретизації внутрішніх процедур, від яких залежить ефективність алгоритму. Це є вибір способу розбиття та кількості підмножин, розрахунок оцінок, вибір підмножини для подальшого розбиття.

Конкретизація і підбір внутрішніх процедур залежить від типу задачі. Але мають виконуватися такі загальні умови.

Процедура розбиття має бути такою, щоб для конкретної задачі до початку роботи алгоритму була відома максимальна кількість рівнів r_{\max} , що буде використана.

Верхні і нижні оцінки повинні розраховуватися значно швидше ніж розв'язування задачі в цілому будь-яким іншим методом. При цьому оцінки мають бути побудовані таким чином, щоб для максимального рівня r_{\max} на кроці 4 виконувалася умова $L_i^{r_{\max}} \geq f_R, i = 1, \dots, k_{r_{\max}}$, така ж нерівність має виконуватися на будь-якому рівні для підмножин, які не можна розбити. Нижні оцінки не мають бути вище за оптимальний розв'язок задачі на поточній підмножині $L_i^r \leq \min\{f(x, y) \mid g(x, y), x \in \Omega_i^r\}$, а верхні оцінки U_i^r мають бути значеннями цільової функції $f(x, y)$ на знайдених припустимих розв'язках задачі.

Якщо внутрішні процедури відповідають таким умовам, то метод повернеться на рівень 0 за скінчену кількість кроків і буде виконана нерівності $L^0 + \varepsilon \geq f_R = \min\{\text{серед знайдених допустимих розв'язків}\}$, що означає, що найкращий припустимий розв'язок є також і ε -оптимальним розв'язком.

Метод гілок та меж генерує дерево пошуку розв'язку, яке потенційно містить всі допустимі цілочисельні значення змінних x . Але в залежності від вибраних процедур та бажаної точності ε піддерево, по якому пройде метод, може бути значно меншим, що напряму впливає на час пошуку розв'язку.

Існують різні стратегії пошуку на дереві розв'язків. А саме:

- пошук в глибину, що веде до більш швидкого зменшення рекордного значення f_R ;
- пошук у ширину, що веде до швидшого скорочення дерева пошуку за рахунок збільшення мінімальної нижньої оцінки;
- вибір для розбиття в першу чергу вершини з кращими оцінками (мінімальна нижня оцінка L_i^r або мінімальна різниця $U_i^r - L_i^r$);
- інші евристики.

Одним з головних недоліків «класичного» підходу до пошуку на дереві є те, що максимальний «час», протягом якого вибраний на рівні r елемент розбиття може залишатися незмінним, є пропорційним кількості вершин дерева, що є дочірніми до цього елемента, а це – величина порядку $O(2^{r_{\max}-r})$. Тобто, чим вище рівень елемента, тим довше він не змінюється при пошуку. Це може призводити до того, що метод витрачає багато часу на пошук на множині розв'язків, серед яких немає «хорошої» верхньої оцінки.

Цей недолік пропонується подолати за рахунок динамічної побудови дерева розгалуження. А саме, за деяким правилом алгоритм, що реалізує метод, має змінювати через певну кількість кроків або через певний час порядок розбиття початкової множини Ω на підмножини. Зрозуміло, що такий порядок залежить від множини Ω та способу розбиття. Так у випадку, коли компоненти вектора x є булевими змінними, а множина Ω складається з вершин одиничного гіперкубу і розбиття здійснюється на дві підмножини шляхом фіксації окремих компонент на значеннях 0 або 1, зміною порядку розбиття може бути відміна фіксацій, що були зроблені на рівнях з 1-го по $r_{\max}/2$, якщо на рівні r_{\max} був знайдений припустимий розв'язок $U^{r_{\max}}$, що дав покращення рекорду f_R . Це дасть можливість шукати наступне покращення, використовуючи знайдений рекорд.

Розглянемо тепер побудову нелінійних оцінок на прикладі задачі пошуку k медіан у неперервному просторі з евклідовою метрикою [9].

Задача полягає у пошуку множини C , що складається з k точок $\vec{y}_i \in R^n$, $i = 1, \dots, k$, у просторі розмірності n таких, що сума зважених евклідових відстаней від m зафіксованих точок $\vec{p}_j \in R^n$, $j = 1, \dots, m$, до множини C є мінімальною.

Задачу можна сформулювати таким чином

$$\min_{\vec{y}_i, x_{ij}, \rho_j} \sum_{j=1}^m c_j \rho_j, \quad (1)$$

за умов

$$\|\vec{y}_i - \vec{p}_j\|_2 \leq \rho_j + (1 - x_{ij})M, \quad i = 1, \dots, k, \quad j = 1, \dots, m, \quad (2)$$

$$\sum_{i=1}^k x_{ij} \geq 1, \quad j = 1, \dots, m, \quad (3)$$

$$x_{ij} \in \{0,1\}, i = 1, \dots, k, j = 1, \dots, m, \quad (4)$$

$$\vec{y}_i \in R^n, i = 1, \dots, k; \rho_j \in R^1, j = 1, \dots, m, \quad (5)$$

де M велике число із значенням не меншим ніж $\max_{i,j=1,\dots,m} \|\vec{p}_i - \vec{p}_j\|_2, c_j > 0$.

При побудові нижньої оцінки для задачі (1) – (5) на рівні розгалуження r частина булевих змінних x_{ij} є фіксованою, а нефіксовані змінні ми будемо розглядати як неперервні. В такому випадку задача (1) – (5) стає опуклою з ко-нічними обмеженнями (2) другого порядку. Для її розв'язання можуть бути використані як загальні методи опуклого програмування [10], так і спеціально розроблені для задач з конічними обмеженнями.

Верхня оцінка отримується за рахунок побудови допустимого розв'язку з використанням евристики при збереженні значень фіксованих змінних. На-приклад, може бути використані евристики, що описані в [7] або [9].

Константа M відіграє важливе значення при розв'язуванні задачі (1) – (5). Формально її значення може бути як завгодно великим, але це погіршує оцінки знизу. При використанні значення меншого ніж вказане вище задача не втрачає сенсу. Так при значенні 0 задача перетворюється в задачу Вебера [11] пошуку одного центру для всіх точок $\vec{p}_j, j = 1, \dots, m$ з мінімальною сумою відстаней.

Для демонстрації залежності розв'язку задачі (1) – (5) при булевих та неперервних змінних x_{ij} від значення константи M розв'язано серію задач для 20 точок і 3-х центрів з прикладу в [9]. Значення розв'язків наведено в табл. 1.

ТАБЛИЦЯ 1. Порівняння результатів для різних типів змінних

M	Булеві змінні x_{ij}	Неперервні змінні x_{ij}
0	1.176697	1.176697
1	0.9252061	0.5983953
2	0.5065739	0.2518134
3	0.4386914	0.1088168
4	0.4074184	0.0405136
5	0.4074184	0.0
7	0.3820393	0.0

Розрахункове значення M для цієї задачі дорівнює 6.1444. Але при такому значенні нижня границя дорівнює 0, що є неприйнятним. Щоб покращити нижню оцінку введемо квадратичні штрафи за нецілі значення змінних x_{ij} , а саме, добавимо до (1) штрафну складову

$K \cdot \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^m x_{ij}(1 - x_{ij})$, де $K > 0$ – штрафний множник. Такий штраф робить задачу неопуклою та багато екстремальною, але при невеликих значеннях K в задачі залишається один мінімум. Залежність цільової функції (1) та штрафу від значення K при $M = 7$ в результаті пошуку локального мінімуму задачі (1) – (5) з неперервними змінними x_{ij} наведено в табл. 2.

Бачимо, що при значенні $K = 0.05$ цільова функція (1) не змінилася, а при $K = 0.5$ її значення перевищує оптимальне значення при булевих змінних. Отже, збільшити нижню оцінку і при цьому не перевищити значення розв'язку початкової задачі та зберегти один локальний мінімум можна

при незначному штрафному коефіцієнті K , контролюючи його через величину цільової функції (1).

ТАБЛИЦЯ 2. Залежність результату від величини коефіцієнта

K	Цільова функція (1) + штраф	Цільова функція	Штраф без K
0.05	0.1918472	0.0	3.836944
0.1	0.3071568	0.02484152	2.823153
0.5	0.9428522	0.7168544	0.4519957
0.75	0.7836932	0.7836932	0.0

Результати.

Висновки.

Подяки. Якщо є.

(Список літератури на мові оригіналу в порядку цитування та інтернет-адреси, як гіперпосилання, якщо є.

Для англomовних посилань це передусім – DOI. Для пошуку DOI можна скористатися сервісом CrossRef <https://apps.crossref.org/SimpleTextQuery>.

Для журналів, які перекладаються (Кибернетика и системный анализ → Cybernetics and System Analysis), дати DOI та посилання для англійської версії.

Так буде краще для цитування тим авторам, на яких посилаються.

Результати пошуку DOI можуть залежати від стилю посилання. Результати необхідно перевірити, адже автомат може помилятися.

Зразки посилань згідно ДСТУ 8302_2015 тут [Зразки_1](#), [Зразки_2](#), [Зразки_3](#).

Є інтернет сервіси, наприклад, <https://www.grafiati.com/> (Шрифт 9.5)

Список літератури

1. Метрологическое обеспечение. <http://metrob.ru/html/mo/> (звернення: 01.02.2020)
2. Internet image collection ImageNet. <http://www.image-net.org> (звернення: 13.01.2020)
3. Вдовиченко Р.О. Реалізація розподіленої пам'яті на сучасних графічних процесорах і дослідження характеристик моделі. *Комп'ютерна математика*. 2019. 1. С. 77–84. <http://dspace.nbu.gov.ua/handle/123456789/161936>
4. Михалевич В.С., Трубин В.А., Шор Н.З. Оптимизационные задачи производственно-транспортного типа. М.: Наука, 1986. 264 с.
5. Кузьменко В.Н., Бойко В.В. Использование PНК-метода для решения невыпуклых задач оптимизации. *Теорія оптимальних рішень*. 2012. 11. С. 47–52. <http://dspace.nbu.gov.ua/handle/123456789/85015>
6. Akinc U., Khumawala B.M. An efficient branch and bound algorithm for the capacitated warehouse location problem. *Management Science*. 1977. 23 (6). P. 545–665. <https://doi.org/10.1287/mnsc.23.6.585>

Одержано 18.03.2019

Кузьменко Віктор Миколайович,

кандидат фізико-математичних наук, старший науковий співробітник

Інституту кібернетики імені В.М. Глушкова НАН України, Київ,

<https://orcid.org/0000-0001-7284-3662>

kvn_ukr@yahoo.com

Бойко Валентина Володимирівна,

молодший науковий співробітник Інституту кібернетики імені В.М. Глушкова НАН України, Київ.

Розширена анотація трьома мовами: англійською, російською, українською.

Не менш ніж 1800 знаків із ключовими словами кожна. (Біля 2/3 стрінки, якщо із назвою).

Анотація трьома мовами буде розміщена на сайті збірника.

Російська та англійська будуть також надруковані.

(E-mail вказати для автора, з яким буде вестися листування від імені усіх співавторів)

MSC 90C15, 49M27

Valentyna Boyko ¹, Viktor Kuzmenko ^{1*}

A Dynamic Branching Based on Nonlinear Estimations in the Branch and Bound Method

¹ V.M. Glushkov Institute of Cybernetics of the NAS of Ukraine, Kyiv

* Correspondence: kvn_ukr@yahoo.com

Introduction. An approach for solving integer and combinatorial optimization problems based on the idea of branch and bound (BnB) leads to wide class of algorithms that allow solving difficult optimization problems either precisely or with controlled precision. Such methods exist in various forms.

Mentioned approach is appropriate when searching for optimal solutions by direct methods is difficult both in the theoretical sense and in the sense of volume of required calculation for solving instances with specific data.

This article proposes a method for dynamically constructing branching tree in the branch and bound method. This means changing the root vertex and the order of other vertices during search process. We also propose to use nonlinear estimations. Such changes in BnB algorithm lead to an increasing of its efficiency.

The purpose of the article is to show how dynamic construction of the branching tree together with nonlinear estimations reduce the searching work on the branching tree and how much different estimations are better in comparison with linear one.

We propose some variants of estimation problem for initial uncapacitated allocation problem for objects in continuous space with various distance metric.

Results. We proposed and tested some variants of nonlinear estimating problem. The properties of such problems depend on value of regulating parameter. The dependence of estimation on value of parameter was studied. It was defined a range for parameter's value for which estimating problem gives adequate result for initial task.

Numerical examples show how much volume of calculations reduces when using a dynamic branching tree.

Conclusions. It is possible to speed up the process of finding the optimal solution by using dynamic branching tree and nonlinear estimations. However, properties of such tree and estimation result significantly depend on the initial task. This fact is a difficulty for development a general algorithm.

Keywords: branch and bound method, branching tree, nonlinear estimation, dynamic tree.

УДК 519.85

В.В. Бойко ¹, В.Н. Кузьменко ^{1*}**Динамическое ветвление на основе нелинейных оценок в методе ветвей и границ**¹ *Институт кибернетики имени В.М. Глушкова НАН Украины, Киев** *Переписка: kvn_ukr@yahoo.com*

Введение. Подход к целочисленной и комбинаторной оптимизации на основе идеи ветвей и границ ведет к широкому классу алгоритмов, позволяющих решать трудные задачи или точно, или в пределах некоторых обоснованных оценок. Эти методы существуют в различных видах и формах.

Использование такого подхода целесообразно, когда поиск оптимальных решений прямыми методами является сложной проблемой как в теоретическом смысле, так и в смысле необходимого объема расчетной ковы для задач с конкретными данными.

В статье предложен способ динамического построения дерева разветвления в методе ветвей и границ, что означает изменение корневой вершины и порядка других вершин в процессе поиска. Также предложено использовать нелинейные оценки. Такие изменения приводят к повышению эффективности метода ветвей и границ.

Цель работы заключается в том, чтобы показать, как использование динамического построения дерева ветвлений вместе с нелинейными оценками позволяет сократить объем поиска на дереве разветвления и оценить на сколько улучшаются оценки для различных вариантов оценочной задачи.

Предложены варианты оценочных задач для задачи размещения объектов в непрерывном пространстве с различными метриками и с центрами без ограничения объемов выполнения работ.

Результаты. Построены оценочные задачи, свойства которых регулируются параметром, для задачи размещения объектов в евклидовом пространстве. Исследованы свойства оценочной задачи в зависимости от значения параметра и показаны пределы значения параметра, соблюдение которых позволяет получать оценки, адекватные начальной задаче.

На примерах показано насколько уменьшается перебор вариантов при использовании динамического дерева ветвлений.

Выводы. Построение динамического дерева ветвлений и нелинейных оценок позволяет ускорить процесс поиска оптимального решения, но существенно зависит от начальной задачи, что усложняет разработку общего алгоритма.

Ключевые слова: методе ветвей и границ, дерево разветвления, нелинейные оценки, динамическое дерево.

УДК 519.85

В.В. Бойко ¹, В.М. Кузьменко ^{1*}**Динамічна побудова гілок на основі нелінійних оцінок у методі гілок та меж**¹ *Институт кибернетики імені В.М. Глушкова НАН України, Київ** *Листування: kvn_ukr@yahoo.com*

Вступ. Підхід до цілочисельної та комбінаторної оптимізації на основі ідеї гілок та меж веде до широкого класу алгоритмів, що дають можливість розв'язувати трудні задачі або точно, або в межах деяких обґрунтованих оцінок. Ці методи існують у різних видах та формах.

Використання такого підходу є доцільним, коли пошук оптимального розв'язку прямими методами є складною проблемою як в теоретичному сенсі, так і в сенсі необхідного об'єму розрахунків для задач з конкретними даними.

У статті запропоновано спосіб динамічної побудови дерева розгалуження у методі гілок та меж, що означає зміну кореневої вершини та порядку інших вершин у процесі пошуку. Також запропоновано використання нелінійних оцінок. Такі зміни призводять до підвищення ефективності методу гілок та меж.

Мета роботи – показати як використання динамічної побудови дерева розгалужень разом із нелінійними оцінками дозволяє скоротити об'єм пошуку на дереві розгалуження та оцінити на скільки покращуються оцінки для різних варіантів оціночної задачі.

Запропонувати варіанти оціночних задач для задачі розміщення об'єктів у неперервному просторі із різними метриками та з центрами без обмеження обсягів виконання робіт.

Результати. Побудовано оціночні задачі, властивості яких регулюються параметром, для задачі розміщення об'єктів в евклідовому просторі. Досліджені властивості оціночної задачі в залежності від значення параметра та показані межі значення параметра, дотримання яких дозволяє отримувати оцінки, адекватні початковій задачі.

На прикладах показано наскільки зменшується перебір варіантів при використанні динамічного дерева розгалужень.

Висновки. Побудова динамічного дерева розгалужень та нелінійних оцінок дозволяє прискорити процес пошуку оптимального розв'язку, але суттєво залежить від початкової задачі, що ускладнює розробку загального алгоритму.

Ключові слова: методи гілок та меж, дерево розгалуження, нелінійні оцінки, динамічне дерево.

Список посилань латиницею. Цей список буде розміщено на сайті збірника.

Якщо посилання, що записане кирилицею, не має англомовної версії, то здійснюється переклад. При цьому:

імена авторів записуються в транслітерації;

назви статей (книг) перекладаються на англійську мову;

назви джерел (видань) подаються в транслітерації;

для інших вихідних даних використовуються числа.

Правильна транслітерація важлива для того, щоби автоматичні системи фіксування посилань змогли зафіксувати посилання.

Вказується мова оригіналу (якщо не англійська).

Вказують інтернет-адреси, як гіперпосилання (якщо є). І перш за все це DOI.

Для пошуку DOI можна скористатися сервісом CrossRef <https://apps.crossref.org/SimpleTextQuery>

Результати пошуку можуть залежати від стилю посилання. Результати треба перевірити, оскільки система може помилитися.

Міжнародні стилі посилань можна подивитися тут <https://libguides.williams.edu/citing/acs>

Стиль оформлення References є найближчий до [ACS-style](#).

References

1. Metrological support. (in Russian) <http://metro.ru/html/mo/> (accessed: 01.02.2020)
2. Internet image collection ImageNet. <http://www.image-net.org> (accessed: 13.01.2020)
3. Vdovychenko R.O. Implementation of Distributed Memory for modern GPU and investigation of features of the model. *Kompyuterna matematika*. 2019. 1. P. 77–84. (in Ukrainian) <http://dspace.nbuv.gov.ua/handle/123456789/161936>
4. Mikhalevich V.S., Trubin V.A., Shor N.Z. Optimization problems for production and transportation planning. M.: Nauka, 1986. 264 p. (in Russian)
5. Kuzmenko V.N., Boyko V.V. Using PNK-method for solving nonconvex optimization problems. *Teoria optimal'nykh rishen'*. 2012. 11. P. 47–52. (in Russian) <http://dspace.nbuv.gov.ua/handle/123456789/85015>
6. Akinc U., Khumawala B.M. An efficient branch and bound algorithm for the capacitated warehouse location problem. *Management Science*. 1977. 23 (6). P. 545–665. <https://doi.org/10.1287/mnsc.23.6.585>