

УЧЕНЫЕ ЗАПИСКИ № 2 (41)

СИМФЕРОПОЛЬСКОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО УНИВЕРСИТЕТА

Математика. Физика. Химия. Биология.
Физическая культура.СИНТЕТИЧЕСКИЙ ПОДХОД К РЕШЕНИЮ ДИСКРЕТНЫХ ЗАДАЧ
ОПТИМИЗАЦИИ ПРИ НЕПОЛНЫХ ДАННЫХ

В.И.Донской, доктор физико-математических наук, профессор

Введение

Пусть X - произвольное множество альтернатив, в котором полагаются существующими подмножества, называемые множеством допустимых альтернатив X и множеством наилучших альтернатив $\{x^*\}$, такие, что $\{x^*\} \subset X \subset X$. Предполагается, что все элементы в $\{x^*\}$ равноценны по некоторому целевому критерию выбора. Подмножество $\{x^*\}$, способ его выявления и даже само множество X не заданы полностью: существует лишь некоторая информация $I_0 = I_0(X, \{x^*\})$, на основе которой формулируется задача D : используя информацию I_0 , отыскать в X множество наилучших альтернатив $\{x^*\}$ или хотя бы один из элементов этого множества.

Пусть $\{I\} = \{I(X), \{x^*\}\}$ - множество различных информаций; элементы множества $\{I\}$ будем обозначать символами I_0, I_1, \dots . Пространством возможных информаций J будем называть замыкание множества $\{I\}$ относительно любого числа объединений и пересечений его элементов.

Множество всех альтернатив X таких, что наличие информации I_0 влечет истинность предиката " $x \notin \{x^*\}$ " обозначим $\overline{\mathfrak{R}}_0$; множество $\mathfrak{R}_0 = X \setminus \overline{\mathfrak{R}}_0$ назовем исходной областью неопределенности выбора альтернатив в задаче D ; любое множество $\mathfrak{R} \subseteq \mathfrak{R}_0$ назовем областью неопределенности.

Решение задачи D предполагает синтез алгоритма A , реализующего отображение

$$A: J \rightarrow 2^X,$$

где 2^X - булеан множества X . Будем обозначать $\{A\}$ - множество любых таких алгоритмов и A_0, A_1, \dots - его произвольные элементы.

Алгоритм A называется точным на информации $I \in J$, если $A(I) \subseteq \{x^*\}$ и абсолютно точным, если $A(I) = \{x^*\}$. Если для информации I найдется точный (абсолютно точный) алгоритм $A \in \{A\}$, то эта информация называется полной (абсолютно полной). В противном случае информация I называется неполной, и речь идет о неполных данных.

Алгоритм A называется согласованным с информацией I для задачи D , если $\{x^*\} \subseteq A(I) \subseteq \mathfrak{R}_0$. Если к задаче D применен согласованный алгоритм A , то получено множество $\mathfrak{R}_A = A(I_0)$ такое, что $\{x^*\} \subseteq \mathfrak{R}_A$. Полученное соотношение есть ни что иное, как некоторая информация о множестве $\{x^*\}$, которую обозначим I_A . Эта инфор-

мация, вообще говоря, может пополнить исходную информацию I_0 и позволить далее располагать информацией $\hat{I}_0 = I_0 \cup I_A$.

Пусть имеется начальная информация $I_0 \in J$. Любую информацию $I_1 \in J$ будем называть дополнительной, если $I_0 \neq I_1 \neq \emptyset$. Дополнительная информация I_1 называется сужающей, если найдется такой согласованный алгоритм $A_1 \in \{A\}$, что выполняются включения: $A(I_0) \supset A_1(\hat{I}_0 \cup I_1) \supseteq \{x^*\}$, где A - произвольный согласованный алгоритм.

Последовательный процесс сужения области неопределенности при решении задачи D с исходной информацией I_0 состоит в нахождении такой последовательности дополнительных информаций I_1, \dots, I_k и синтеза таких алгоритмов A_0, A_1, \dots, A_k , что

$$A_0(I_0) \supset A_1(\hat{I}_0 \cup I_1) \supset \dots \supset A_k(\hat{I}_{k-1} \cup I_k) \supseteq \{x_k^*\}.$$

Принцип наибольшего сужения области неопределенности в случае конечных дискретных множеств предполагает использование дополнительной информации и выбор алгоритмов так, чтобы мощность множества $\{\mathfrak{R}_{j-1} \setminus \mathfrak{R}_j\}$ была как можно большей, $\mathfrak{R}_j = A_j(\hat{I}_{j-1} \cup I_j)$, $j = \overline{1, k}$.

В данной статье рассматривается класс задач дискретной оптимизации, для которых имеются неполные данные о некоторых компонентах модели

$$\text{extr } f(\tilde{x}) / \tilde{x} \in \Omega \subset B^n; B^n = \{0, 1\}^n;$$

$$f: B^n \rightarrow R; \tilde{x} = (x_1, \dots, x_n).$$

Иначе говоря, предполагается существование функции f и непустого множества Ω , которые задаются некоторой неполной информацией $I_0 = I_0(f, \Omega)$. Нахождение по этой информации I_0 решения

$$\{x^*\} = \text{arg extr } f(\tilde{x}) / \tilde{x} \in \Omega$$

и является решаемой задачей.

1. Принципы синтетического подхода.

Существуют разнообразные практические постановки задач дискретной оптимизации с неполной информацией, и применяемые подходы к решению зависят от того, как эта информация представлена.

Целевая функция f может быть частично задана в некоторых точках-вершинах единичного n -мерного куба B^n . Может быть частично задано отношение предпочтения:

$$\rho_\Delta \subset \rho \stackrel{\Delta}{=} \{(\tilde{x}, \tilde{y}), f(\tilde{x}) \leq f(\tilde{y})\}.$$

Множество Ω может быть представлено набором прецедентов $\{M_0 \cup M_1\}$ таким, что точно известно: $M_0 \subset \Omega$, $M_1 \subset \{B^n \setminus \Omega\}$. В этом случае для восстановления множества обычно применяют методы эмпирической индукции (распознавание образов) [1]. Возможно частичное задание множества Ω некоторой логической системой продукций [2], определяющей алгоритмы вычисления истинности предиката $g_0(\tilde{x}) \equiv \tilde{x} \in \Omega$ на некотором подмножестве $M_0 \subset \Omega$ и $g_1(\tilde{x}) \equiv \tilde{x} \notin \Omega$ на подмножестве $M_1 \subset \{B^n \setminus \Omega\}$.

Дискретные модели оптимизации с неполной исходной информацией представляют подкласс моделей принятия решений, и их изучение и создание соответствующих численных методов имеют важное значение для развития информационных систем поддержки принятия решений и проблематики искусственного интеллекта.

С целью существенного продвижения вперед в области построения дискретных моделей принятия решений, удовлетворения потребностей разработчиков интеллектуализированных систем в информатике, повышения точности и обоснованности решений разработан синтетический подход, основные принципы которого состоят в следующем.

1. Соединение, комбинирование методов принятия решений, использующих различную исходную информацию, существенно дополняющих друг друга, например, эмпирической индукции и дедуктивного вывода на основе баз знаний.

2. Принятие решений на основе синтеза и сопоставления логических описаний областей истинности заключений, построенных различными методами.

3. Привлечение разнообразной дополнительной информации, обеспечивающей наибольшее сужение области неопределенности, выявление и использование для этой цели математических свойств моделей решений - дискретности, линейности, монотонности, соответствия определенной структуре (например, матричной) и т.п.

4. Комбинирование математических методов, привлечение для выбора альтернатив разнообразного математического аппарата, совместно используемого при решении задачи, например, теории игр и минимизации дизъюнктивных форм, методов оптимизации и распознавания образов.

2. Каноническое представление задачи.

Обозначим класс псевдодобулевых функций $PS_2(n) \triangleq \{f: B^n \rightarrow R\}$.

Определение 2.1. Две формы представления оптимизационной задачи называются эквивалентными, если множества их решений в точности совпадают.

Теорема 2.1. [3]. Для любой задачи условной оптимизации в форме

$$\text{extr } f(\tilde{x}) / \tilde{x} \in \Omega, \tilde{x} \in B^n, \quad (2.1)$$

существуют эквивалентные формы представления:

$$\text{а) } \text{extr } f(\tilde{x}) / h(\tilde{x}) \leq 0, \tilde{x} \in B^n, \quad (2.2)$$

с единственным ограничением в виде нестрогого неравенства, где есть некоторый полином, и

$$\text{б) } \text{extr } f(\tilde{x}) / \prod_{j=1}^m x_{j_1}^{\sigma_{j_1}} \& \dots \& x_{j_r}^{\sigma_{j_r}} = 1, \quad (2.3)$$

где $x^\sigma = x$, если $\sigma = 1$, $x^\sigma = \bar{x}$, если $\sigma = 0$.

Представление задачи (2.1) в форме (2.3) будем называть каноническим. Это представление имеет ограничение в виде логического уравнения с дизъюнктивной нормальной формой (ДНФ) в левой части. Такое ограничение называется дизъюнктивным или ДНФ-ограничением.

Каноническое представление задачи (2.3) имеет большое значение для реализации синтетического подхода. В частности, ДНФ-ограничение может быть синтезировано и при помощи индуктивного обобщения неполной информации о прецедентах, и путем построения логического описания области выводимости факта "быть допустимым решением".

Далее приводятся конкретные способы реализации синтетического подхода к решению дискретных задач оптимизации с неполной информацией.

3. Сужение области неопределенности на основе дополнительной информации о линейности задачи

Задачи вида

$$\left\{ \begin{array}{l} \max x \sum_{i=1}^n a_i x_i / \sum_{i=1}^n b_{ij} x_i \leq B_j; j = \overline{1, m} \\ x_i \in \{0,1\}; a_i \geq 0; B_j \geq 0; b_{ij} \geq 0; i = \overline{1, n} \end{array} \right. \quad (3.1)$$

называются задачами линейного булевого программирования с неотрицательными коэффициентами.

Зададим функции алгебры логики (ф.а.л.) $F_j(\tilde{x})$, $j = \overline{1, m}$, так, что

$$(F_j(\tilde{x}) = 0) \Leftrightarrow \left(\sum_{i=1}^n b_{ij} x_i - B_j \leq 0 \right).$$

Тогда F_j - монотонные ф.а.л. [1]; функция

$$F_0(\tilde{x}) = \bigvee_{j=1}^m F_j(\tilde{x})$$

также является монотонной и описывает область допустимых решений Ω в задаче (3.1): $\Omega = \{ \tilde{x} \in B^n : F_0(\tilde{x}) = 0 \}$.

Теперь рассмотрим следующую задачу:

$$\left\{ \begin{array}{l} \max x \sum_{i=1}^n a_i x_i \\ \text{при условии, что заданы подмножества} \\ M_0^f \subset M_0^{F_0}; M_1^f \subset M_1^{F_0} \\ \text{такие, что каждый набор } \tilde{x} \in M_0^f \text{ является} \\ \text{допустимым решением, а каждый набор } \tilde{x} \in M_1^f \\ \text{таким не является;} \\ \tilde{x} \in B^n; a_i \geq 0, i = \overline{1, n}. \end{array} \right. \quad (3.2)$$

В этой задаче предполагается, что существуют множества $M_0^{F_0} = \{ \tilde{x} \in B^n : F_0(\tilde{x}) = 0 \}$, $M_1^{F_0} = \{ \tilde{x} \in B^n : F_0(\tilde{x}) = 1 \}$, но $F_0(\tilde{x})$ — функция, определяющая допустимые решения задачи, — задана частично указанием множеств наборов M_0^f, M_1^f , т.е. задана некоторая частичная ф.а.л.

Пусть известно, что задача (3.2.) получена как неполное представление задачи (3.1): например, при исследовании заведомо линейной модели не удалось получить полную информацию о ее ограничениях. В таком случае функция $F_0(\tilde{x})$ является монотонной ф.а.л., и проблема нахождения множества допустимых решений Ω сводится к отысканию монотонной функции $F_0(\tilde{x})$.

Теорема 3.1. [1] . Функция $f \in P_2(n)$, не являющаяся константой, монотонна в том и только в том случае, если для любых пар вершин $\tilde{x}, \tilde{y} \in B^n$, в которых $f(\tilde{x}) = 1$ и $f(\tilde{y}) = 0$, найдется переменная с номером $i \in \{1, 2, \dots, n\}$ такая, что $x_i = 1$ и $y_i = 0$.

Следствие. Если во множествах M_0^f и M_1^f частичной ф.а.л. f найдутся такие наборы $\tilde{\alpha} \in M_0^f$ и $\tilde{\beta} \in M_1^f$, что не существует переменной с номером $i \in \{1, 2, \dots, n\}$, для которой $\alpha_i < \beta_i$, то f не может быть доопределена монотонной функцией.

Пусть $\Phi \subset P_2(n)$ - класс монотонных функций таких, что для любой функции $\varphi \in \Phi$ выполняется условие:

$$\left[\forall \tilde{x} \in M_0^f (\varphi(\tilde{x}) = 0) \right] \wedge \left[\forall \tilde{x} \in M_1^f (\varphi(\tilde{x}) = 1) \right] \quad (3.3)$$

Очевидно, $F_0 \in \Phi$, и произвольная функция $\varphi \in \Phi$ может отличаться от F_0 только на множестве $B^n \setminus \{ M_0^f \cup M_1^f \}$.

Если F - класс произвольных функций из $P_2(n)$, удовлетворяющих условию (3.3), а $\{x^*\}$ - множество решений задачи (3.1), являющейся "порождающей" для задачи (3.2), то выполняются включения:

$$M_0^F \supset M_0^\Phi \supset \{x^*\} \quad (3.4)$$

$$\text{где } M_0^F = \bigcup_{g \in F} \{\tilde{x} \mid g(\tilde{x}) = 0\}, \quad M_0^\Phi = \bigcup_{\varphi \in \Phi} \{\tilde{x} \mid \varphi(\tilde{x}) = 0\}.$$

Соотношения (3.4) доказывают, что дополнительная информация о линейности задачи (3.2) является сужающей, а соответствующий согласованный алгоритм немедленно "выписывается" из условия - критерия теоремы 3.1 и начальной информации о задаче (3.2).

Алгоритм 3.1.

Шаг 1. Для каждого набора $\tilde{\alpha} \in M_0^f$ выписать конъюнктивную нормальную форму (к.н.ф.) $K(\tilde{\alpha})$, каждая дизъюнкция которой состоит из переменных \tilde{x}_i (с инверсиями) таких, что $\alpha_i < \beta_i$ для одного из наборов $\tilde{\beta} \in M_1^f$; к.н.ф. $K(\tilde{\alpha})$ будет содержать $m_1 = |M_1^f|$ дизъюнкций - ровно столько, сколько наборов содержится во множестве M_1^f .

Шаг 2. В полученных к.н.ф. $K(\tilde{\alpha}_1), \dots, K(\tilde{\alpha}_{m_0})$ раскрыть скобки и выполнить операции поглощения, получая д.н.ф. D_1, \dots, D_m .

Шаг 3. Записать д.н.ф. $D_1 \vee \dots \vee D_m$ и выполнить все возможные операции поглощения. Будет получена некоторая д.н.ф. D^* .

Замечание. Выполнение шага 1 в алгоритме с учетом сформулированной теоремы возможно тогда и только тогда, когда информация в задаче (3.2) не противоречит условию монотонности.

Лемма 3.1. Конъюнкции д.н.ф. D^* перечисляют все альтернативные варианты несокращаемых наборов необходимых нулей в экстремальных решениях $\{x^*\}$, удовлетворяющих дополнительной информации о линейности ограничений (монотонности функции F_0).

Лемма 3.2. $\overline{D^*} \in \Phi$.

Доказательство. Д.н.ф. D^* содержит только отрицательные литералы, поэтому формула $\overline{D^*}$ может быть представлена путем очевидных преобразований в виде д.н.ф., содержащей только положительные литералы, и монотонность $\overline{D^*}$ следует из монотонности конъюнкции, дизъюнкции и замкнутости монотонных ф.а.л. Обозначим

$$M_0^{\overline{D^*}} = \{\tilde{x} \mid \overline{D^*}(\tilde{x}) = 1\}$$

Лемма 3.3. $M_0^\Phi = M_0^{\overline{D^*}}$.

Доказательство. Пусть $\tilde{x} \in M_0^\Phi$. Тогда $\forall \varphi \in \Phi$ имеем $\varphi(\tilde{x}) = 0$, но $\overline{D^*} \in \overline{\Phi}$ по лемме 3.2, поэтому $\overline{D^*}(\tilde{x}) = 0 \Leftrightarrow D^*(\tilde{x}) = 1$, и $\tilde{x} \in M_0^{\overline{D^*}}$.

Обратно, пусть $\tilde{x} \in M_0^{\overline{D^*}}$, т.е. $D^*(\tilde{x}) = 1$. Тогда, по лемме 3.1, \tilde{x} принадлежит объединению максимальных вне множества M_1^f интервалов, каждый из которых содержит хотя бы одну точку из M_0^f , поэтому $\tilde{x} \in M_0^\Phi$.

Следствие. Алгоритм 3.1 является согласованным с начальной информацией задачи (3.2), и дополнительная информация о линейности является сужающей:

$$\{\tilde{x}^*\} \subset M_0^{\overline{D^*}} = M_0^\Phi \subset M_0^F = \{B^n \setminus M_1^f\}.$$

Полученная дополнительная информация может быть представлена в виде дизъюнктивного ограничения $D^*(\tilde{x}) = 1$, присоединяемого к задаче 3.2.

Множества M_0^f и M_1^f , являющиеся частью исходной информации в задаче 3.2, можно рассматривать как стандартную обучающую информацию для задачи распознавания свойства " $\tilde{x} \in \Omega$ " [1].

Решение такой задачи и получение правила классификации в виде д.н.ф. D_R позволяют обосновать выбор решения \tilde{x} из множества M_0^D [1], причем синтезируется каноническое представление задачи с новым дизъюнктивным ограничением $(D^* \wedge D_R)(\tilde{x}) = 1$.

4. Анализ начальной информации и условие точного решения задачи в канонической форме с неполной информацией о целевой функции

Ниже изложен синтетический метод решения задачи оптимизации слабоопределенной линейной псевдобулевой функции с дизъюнктивным ограничением, основанный на нахождении при помощи прецедентной начальной информации системы образующих $\tilde{C} = (C_1, \dots, C_q)$ выпуклого многогранного конуса $K(\tilde{C}) \subset R^n$, которому принадлежит неизвестный вектор

C_0 коэффициентов линейной целевой функции задачи

$$\max(C_0, \tilde{x}) / \tilde{x} \in \Omega \subset B^n.$$

Область допустимых решений Ω предполагается точно заданной дизъюнктивным ограничением

$$\bigvee_{j=1}^m K_j(\tilde{x}) = 1; \quad K_j(\tilde{x}) = x_{j_1}^{\sigma_{j_1}} \& \dots \& x_{j_{r_j}}^{\sigma_{j_{r_j}}};$$

$$\Omega = \left\{ \tilde{x} \in B^n : \bigvee_{j=1}^m K_j(\tilde{x}) = 1 \right\}.$$

Теорема 4.1. Пусть $C_0 \in K(\tilde{C})$, $C_0 \neq 0$, и

$$\forall C \in \text{conv}(\tilde{C}) \quad (C, \tilde{x}^*) = \max_{\tilde{x} \in \Omega} (C, \tilde{x})$$

тогда $(C_0, \tilde{x}^*) = \max(C_0, \tilde{x}) / \tilde{x} \in \Omega$.

Используя эту теорему и представление множества Ω его покрытием

$$\Omega_1 \cup \dots \cup \Omega_j \cup \dots \cup \Omega_m \quad \text{таким, что} \quad (\tilde{x} \in \Omega_j) \Leftrightarrow (K_j(\tilde{x}) = 1), \quad j = \overline{1, m},$$

осуществляется решение m задач на выпуклой оболочке системы \tilde{C} :

$$\max \left(\sum_{k=1}^q \lambda_k C_k, \tilde{x} \right) / K_j(\tilde{x}) = 1; \quad \sum_{k=1}^q \lambda_k = 1; \quad \lambda_k \geq 0, \quad k = \overline{1, q}.$$

Использование дополнительной информации о знаках неизвестного вектора C_0 позволяет получить простое правило вычисления булевых векторов $\tilde{\alpha}_j \in \Omega_j$ таких, что

$$\forall C \in \text{conv}(\tilde{C}) \quad \forall \tilde{x} \in \Omega_j \quad (C, \tilde{\alpha}_j) \geq (C, \tilde{x}).$$

Координаты векторов $\tilde{\alpha}_j = (\alpha_1^j, \dots, \alpha_n^j)$ определяются по формулам:

$$\alpha_i^j = \begin{cases} \sigma_i, & i \in \{j_1, \dots, j_{r_j}\}, \\ 1, & (i \notin \{j_1, \dots, j_{r_j}\}) \& (c_{i0} > 0), \\ 0, & (i \notin \{j_1, \dots, j_{r_j}\}) \& (c_{i0} < 0), \\ \Delta, & (i \notin \{j_1, \dots, j_{r_j}\}) \& (c_{i0} = 0), \end{cases}$$

$i = \overline{1, n}$; Δ - произвольное значение из $\{0, 1\}$.

Далее рассматриваются задачи

$$\begin{cases} \max \sum_{i=1}^n \alpha_i^j (\lambda_1 C_{1i} + \dots + \lambda_q C_{qi}) \\ \lambda_1 + \dots + \lambda_q = 1; \lambda_k \geq 0, k = \overline{1, q}; \end{cases} \quad (4.1j)$$

$$(j = \overline{1, m})$$

$$\begin{cases} \min \sum_{i=1}^n \alpha_i^j (\lambda_1 C_{1i} + \dots + \lambda_q C_{qi}) \\ \lambda_1 + \dots + \lambda_q = 1; \lambda_k \geq 0, k = \overline{1, q}; \end{cases} \quad (4.2j)$$

Экстремумы задач (4.1j) и (4.2j) достигаются в вершинах $(q-1)$ -мерного симплекса и определяются путем нахождения величин $B_j = \max_{1 \leq k \leq q} \sum_{i=1}^n \alpha_i^j C_{ki}$;

$$A_j = \min_{1 \leq k \leq q} \sum_{i=1}^n \alpha_i^j C_{ki}; j = \overline{1, m}.$$

Найденные величины удовлетворяют неравенствам: $\forall C \in \text{conv}(\tilde{C});$

$$\left(A_j \leq \max_{\tilde{x} \in \Omega_j} (C, \tilde{x}) = (C, \tilde{\alpha}_j) \leq B_j \right),$$

из которых с учетом теоремы 4.1 следует, что при выполнении условия

$$\exists j^*: \forall j \neq j^* (A_{j^*} \geq B_j)$$

исходная задача решается точно: $(C_0, \tilde{\alpha}_{j^*}) = \max(C_0, \tilde{x}) / \tilde{x} \in \Omega$. В противном случае применяется теоретико-игровой подход к выбору решения, приводящий к решению матричной игры со стратегиями выбора решений $\tilde{\alpha}_j$ с одной стороны, стратегиями (Природы) выбора образующих (C_1, \dots, C_q) - с другой и с платежной матрицей

$$\left\| h_{ik} = \sum_{i=1}^n \alpha_i^j C_{ki} \right\|_{m \times q}$$

ЛИТЕРАТУРА

1. Донской В.И. Слабоопределенные задачи линейного булевого программирования с частично заданным множеством допустимых решений // Журнал вычисл. математики и матем. физики. 1988. Т.28, №9, с. 1379 - 1385.
2. Донской В.И. Логические продукционные системы: анализ и синтез // Кибернетика и системный анализ. 1994, №5, с. 1 - 21.
3. Донской В.И. Задачи псевдобулевой оптимизации с дизъюнктивным ограничением // Журнал вычисл. математики и матем. физики. 1994. Т. 34, №2, с. 461 - 472.
4. Донской В.И. Дуальные экспертные системы // Изд. Российской АН. Техническая кибернетика. 1993. №5, с. 111 - 119.