קורס מבוא לאופטימיזציה

עבודה מסכמת

**על שיטות לפתרון בעיות אופטימיזציה מרובות מטרות**

ספיר קרויטורו – אור ש. נעים

**הקדמה:**

במאמר זה, נעסוק בשיטות שונות לפתרון בעיות אופטימיזציה מרובות מטרות

(Multi-Objective Optimization MOO). תוך כדי שאנו ממחישים את השיטות על בעיית בניית תיק ההשקעות. בבעיה זו, אנו מתמקדים בשתי מטרות עיקריות; (I) מקסום תוחלת הרווח של התיק (II) מזעור הסיכון שבתיק. בראייה אינטואיטיבית, ניכר כי שתי מטרות אלו **מנוגדות**. מחד גיסא, ככל שמשקיעים יותר, תוחלת הרווח עולה. מאידך גיסא, ככל שמשקיעים פחות הסיכון קטן. ניתן אפוא לומר שבשביל למקסם תוחלת רווח של תיק יש להשקיע כמות כסף אינסופית ואילו בשביל למזער סיכון, מוטב ולא להשקיע כלל. בפרקים [להוסיף מספרי פרקים], נדון בשיטות שונות לשם מציאת איזון בין שתי מטרות אלו, ובמידה ונדרש [יש לציין שיטות שנדרש בהן], נוסיף מטרות נוספות בהתאם לצורך.

~~בעבודה זו נעסוק בבעיית בניית תיק מניות תוך כדי (I) מקסום תוחלת הרווח (II) מזעור הסיכון וקיום האילוץ שבתיק תהיה השקעה בחברה ישראלית אחת לפחות. נשים לב שהמטרות I, II,~~ **~~מנוגדות.~~** ~~מחד גיסא, בשביל למקסם את תוחלת הרווח של התיק, נרצה להשקיע כמה שיותר. אם קיימת חברה שמציעה תוחלת רווח חיובי, ככל שנשקיע בה יותר, כך תוחלת הרווח שלנו תעלה. מאידך גיסא, בשביל למזער את הסיכון, מוטב שלא נשקיע בכלל ונחזיר למעשה תיק מניות ריק.~~

**מושגים:**

פונקציות המטרה מנורמלות

פונקצית המטרה הראשית

פונקציית מטרה לאחר שינוי

Utopia point

וקטור של פונקציות מטרה

אי שיוויון האילוצים

משוואת האילוצים

מספר פונקציות המטרה

*פרמטר של*

*-מספר ,המשתנים העצמיים .*

*זה המספר של אי שיווני האילוצים.*

מעריך החזקה ל global criterion

U פונקציית התועלת

וקטור המשקלים של האילוצים/החזקות

וקטור של משתני ההחלטה

Feasible design space

Aspiration point

Feasible criterion space

**הגדרת הבעיה:**

**בהניתן**  -וקטור של פונקציות מטרה נרצה לקיים:

*כאשר ,*

*פונקצית המטרה ה ,  
 מספר פונקציות המטרה*

*הינו וקטור של משתני החלטה  
 -מספר ,המשתנים העצמיים .*

*זה המספר של אי שיווני האילוצים.  
 זה וקטור של פונקציות מטרה מטרות הפונקציות*

*אין פיתרון כללי לבעית אופטימיזציה של מיקסום מטרות מרובות,נבחן כמה שיטות לפיתרון בעיה זו.  
חלק מהשיטות מכילות מוציאות פיתרון אשר הוא :*

*במילים אחרות ,הפיתרון המתקבל הקצה משאבים בצורה כזו,כך שאי אפשר להקצות אותם מחדש על מנת לשפר את מצבו של פרט או העדפה אחרת מבלי לשנות לרעה את מצבו של פרט אחר או העדפה אחרת.(מתוך ויקפידה)*

*שיטות אחרות לא תמיד מספקות פתרונות , אך מספקים תנאים אחרים המשמשים ליישום מעשי. לדוגמה השיטות מספקות פיתרון :*

*כלומר ,* זה *מצב אי אפשר לשפר את מצבו של כל אחד מפרטים.  
 (Mock, William B T. (2011). "Pareto Optimality". Encyclopedia of Global Justice..)*

*נקודה יכולה להיות* weakly Pareto optimal אם אין נקודה אחרת שמשפרת את כל פונקציות המטרה בו זמנית .לעומת זאת,נקודה יכול להיות Pareto optimal אם אין עוד נקודה שמשפרת לפחות מטרה אחת בלי לשנות לרעה בפונקציה אחרת.  
במילים אחרות Pareto optimal נקודות הן weakly Pareto optimal נקודות אך נקודות שהן weakly Pareto optimal אינן Pareto optimal.

*כדי לקבוע אם נקודה היא* Pareto optimal אנו משתמשים בבדיקה הבאה *:*

אם הוא 0 אז הוא point Pareto optimal .  
נשים לב כי יכול להיות שלבעיה יכול להיות מספר אינסופי של points Pareto optimal .לכן,כל שיטה צריכה להבחין בין שיטות שמספקות נקודהPareto optimal סופית או סט של נקודות פארטו אופטימליות.  
   
*ישנם שיטות אשר מספקות* compromise solution.פיתרון זה ממזער את השוני בין הנקודה אופטימלית לביןutopia point(נקרא גם ideal point):

באופן כללי F◦ היא unattainable .לכן נסתפק בפיתרון הקרוב ככל הניתן לutopia point .פיתרון כזה נקרא compromise solution והוא Pareto optimal. הקושי בפיתרון זה הוא ההגדרה של המילה "קרוב".בדרך ככל ההגדרה של קרוב זה למזער את המרחק האוקלידי.אך בחלק מהמקרים אין צורך להגביל את ההגדרה למקרה של Euclidean norm.אם יש פונקציות מטרה שונות עם יחידות מידה שונות,ה Euclidean norm בכל דרגה לא תמיד מספיקה קרוב בצורה מתמטית.לכן כל פונקצית מטרה צריך להיות ללא מימדים.

**שיטת הקריטריון הכללי הממושקל:**

שיטה נפוצה זו להתמודדות עם בעיות אופטימיזציה מרובות מטרות, נקראת שיטת הקריטריון הכללי הממושקל (Weighted Global Criterion Method). בשיטה זו, כל פונקציות המטרה מתמזגות לכדי פונקציה אחת. פונקציה זו למעשה מייצגת את כל פונקציות המטרה בהתאם למשקל שנתנו להם. כך למשל, אם חשוב לנו יותר למקסם את רווח התיק, מאשר למזער את הסיכון, ניתן לפונקציה שמייצגת את מקסום רווח התיק משקל גדול יותר מהפונקציה שמייצגת את מזעור הסיכון בתיק. במידה ואין לנו העדפות ביחס לפונקציות המטרה השונות בהן עסקינן, והשתמשנו בשיטה זו, אפשר לומר שעבדנו עם **שיטת הקריטריון הכללי**, אך אילו, אנו רוצים לתת את הדעת על מידול העדפותינו כמו בדוגמא הנ״ל, נשתמש בשיטת **הקריטריון הכללי ה*ממושקל***. אחת מפונקציות התועלת הכלליות ביותר מבוטאות בצורתן הפשוטה ביותר כסכום אקספוננטציאלי ממושקל:

ההרחבות הנפוצות ביותר של פונקציות (1), (2) הן של Yu-Leitmann (1974), Zeleny (1982), Chankong-Haimes(1983).

כאן, הנו וקטור של משקלים, אשר לרוב מוגדר על ידי מבצע ההחלטות כך ש ומספר האיברים בווקטור המשקלים הוא כמובן, לפחות 1. אם מאתחלים את אחד או יותר מהמשקולות לאפס, עשויים לקבל יעילות פאראטו חלשה. באופן כללי, הערך היחסי של כל משקולת ביחס לשאר המשקולות, מבטא על חשיבותו היחסית ביחס למשקולות שמייצגות את שאר המטרות. ניתן להסתכל בסכימות שבמשוואות (3), (4) בשתי דרכים: האחת כשינוי של פונקציות המטרה המקוריות השנייה, כרכיבים של פונקציות מרחק שממזערות את המרחק בין הפתרון הנוכחי ונקודת האוטופיה ביחס למרחב של הקריטריון. השלכה של ההסתכלות השנייה היא ששיטות **קריטריון כללי** נקראות גם **שיטות מבוססות נקודת אוטופיה** או **שיטות** **תכנות התפשרותי**, היות ולרוב על מבצע ההחלטה לבצע **פשרה** מסוימת בין הפתרון הסופי לבין נקודת האוטופיה בפועל, לצורך קבלת יעילות חישובית, דהיינו, שימור על זמן ריצה סביר. כאשר מתפשרים על נקודת האוטופיה, כלומר מעריכים אותה על ידי z, מקבלים למעשה נקודה שנקראת **נקודת השאיפה** (Wietzbicki 1986, Miettinen 1999), או **נקודת מטרה** (Hallefjord- Jornsten 1986). [עצרתי בעמוד 6, תחילת חצי שני]

**שיטת הסכום הממושקל:**

זוהי הגישה הנפוצה ביותר לפתרון בעיות אופטימיזציה מרובות מטרות. היא מיוצגת על ידי פונקציית התועלת הבאה:

זוהי למעשה צורה של משוואות (1) או (2) כאשר . ובמילים אחרות, כופלים את התועלת שמתקבלת מכל פונקציית מטרה במשקולת שלה, ולכן, כאשר נצטרך להתפשר על האוטופיה, ננסה להתפשר יותר על המטרות שיש להן משקולת הקלה ולהתפשר פחות על המטרות בעלות המשקולת הכבדה. (Zadeh 1963) הראה כי מזעור משוואה 5, מספיק לקבלת אופטימליות פאראטית.

**מקורות:**

[**https://www.investopedia.com/ask/answers/041415/what-are-some-common-measures-risk-used-risk-management.asp**](https://www.investopedia.com/ask/answers/041415/what-are-some-common-measures-risk-used-risk-management.asp)

**Pareto-Weighted-Sum-Tuning**

**https://github.com/harryw1248/Pareto-Weighted-Sum-Tuning**

**מקור:**

**Pareto-Weighted-Sum-Tuning: Learning-to-Rank for Pareto Optimization Problems**