

Теория принятия решений

НГУ

Факультет информационных технологий

3 курс, 2 семестр

Лектор: **Кочетов Юрий Андреевич**

<http://www.math.nsc.ru/LBRT/k5/or.html>

Теория принятия решений

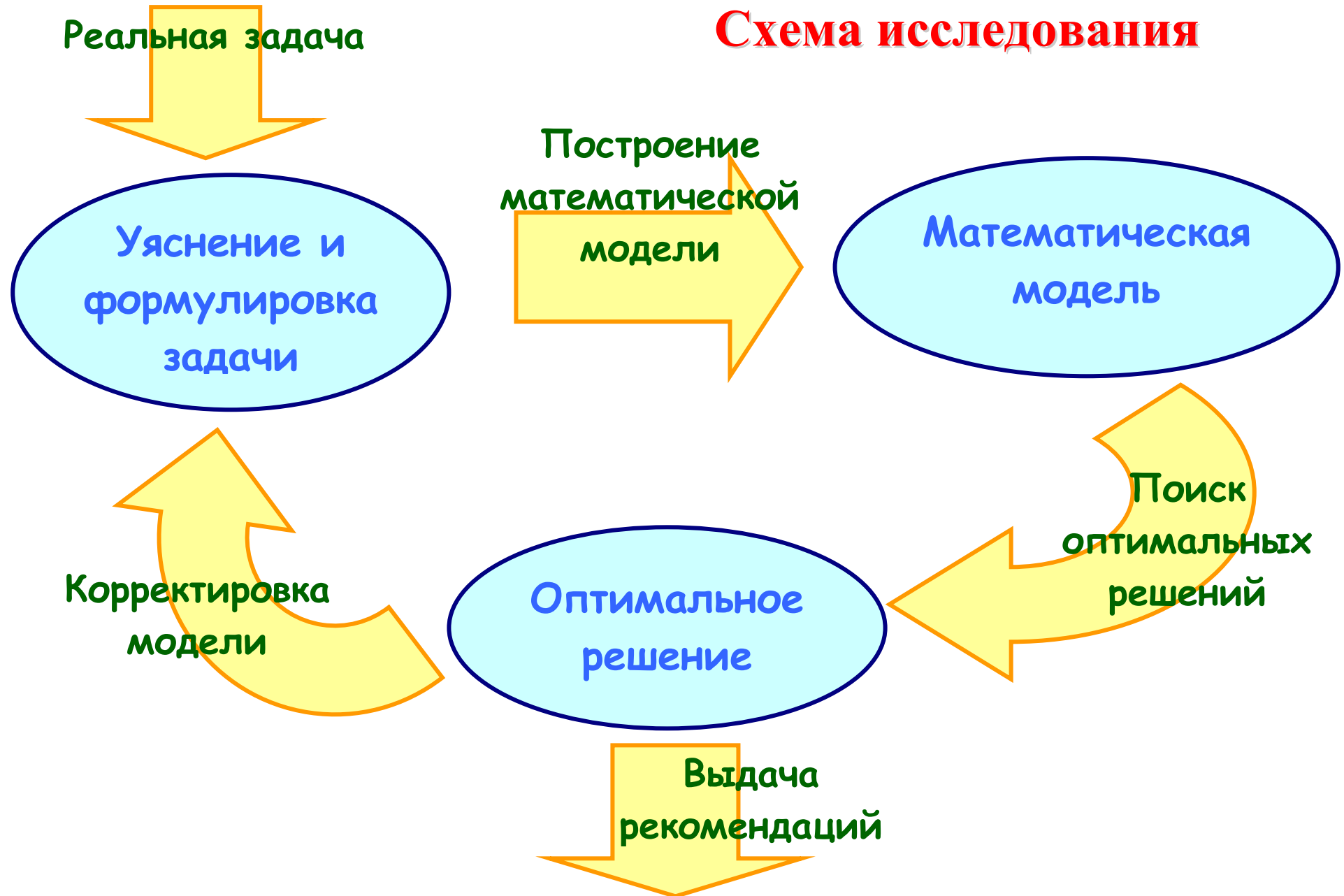
Исследование операций — теория математических моделей и методов принятия решений.

1. Наличие некоторого **процесса**
2. Наличие **управляющих воздействий**
3. Наличие **цели**, ради которой проводится операция
4. **Выбор наилучшего (оптимального) управления**, при котором достигается цель

Операция — система действий, объединенная единым замыслом и направленная на достижение определенной цели.

Основная задача теории оптимальных решений состоит в представлении обоснованных количественных данных и рекомендаций для принятия оптимальных решений.

Схема исследования



Математическая модель

Математическая модель — объективная схематизация основных аспектов решаемой задачи или ее описание в математических терминах.

Математическая модель описывает исследуемую систему и позволяет выразить ее эффективность в виде *целевой функции*

$$W = f(X, Y),$$

где $X = (x_1, \dots, x_n)$ — управляемые переменные,

$Y = (y_1, \dots, y_m)$ — неуправляемые переменные (исходные данные).

Связь между переменными X и исходными данными Y выражается с помощью ограничений

$$\varphi(X, Y) \leq 0.$$

Модели принятия решений

1. Долгосрочное стратегическое планирования:

задачи размещения производства, развитие нефтяной и газовой промышленности

2. Среднесрочное планирование:

транспортные задачи, задачи маршрутизации, задачи календарного планирования с ограниченными ресурсами

3. Оперативное управление:

задачи теории расписаний, задачи раскроя и упаковки

Задачи размещения производства

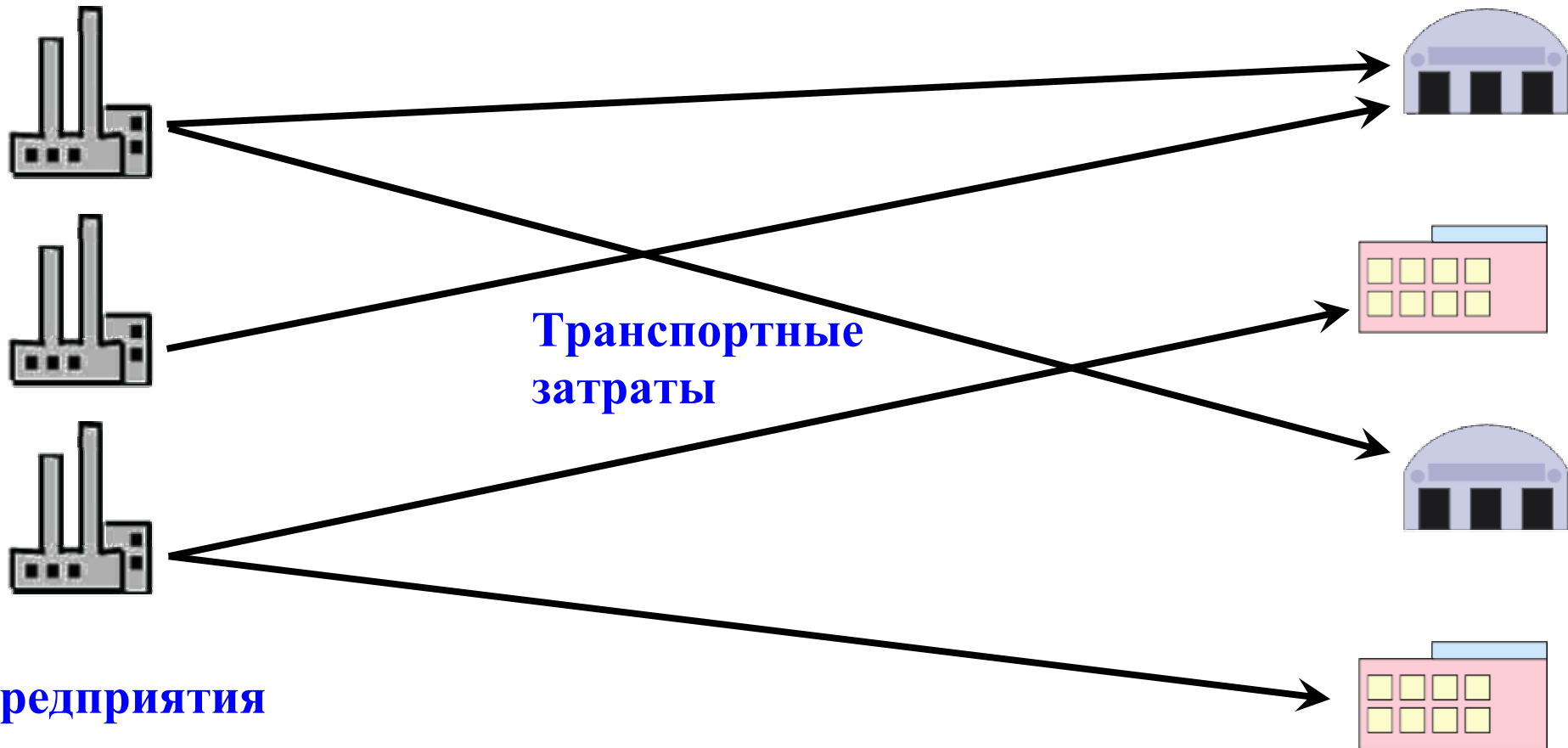


Системы сотовой связи, филиалы банков, производство продукции

Лекция 1. Исследование операций. Динамическое программирование

Транспортные задачи

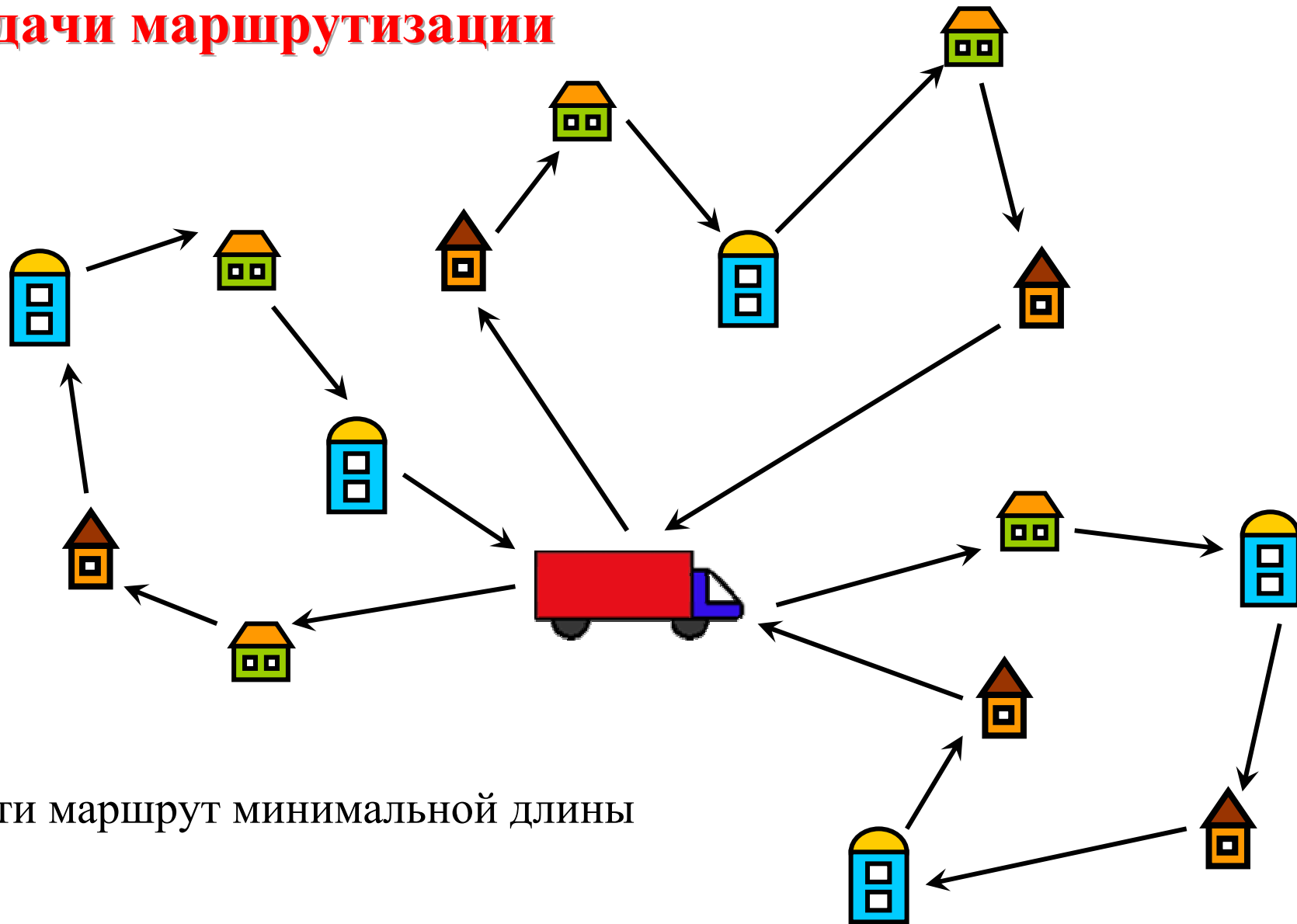
Потребители



Предприятия

Минимизировать затраты на перевозку продукции

Задачи маршрутизации



Найти маршрут минимальной длины

Задачи теории расписаний

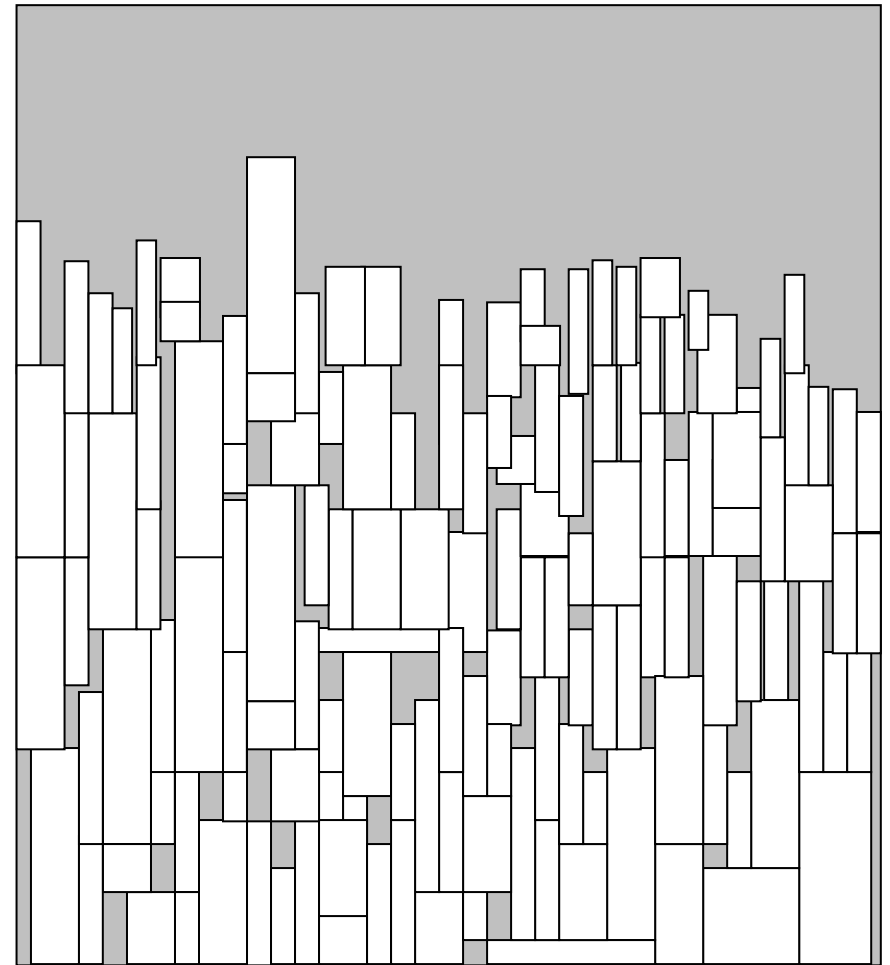
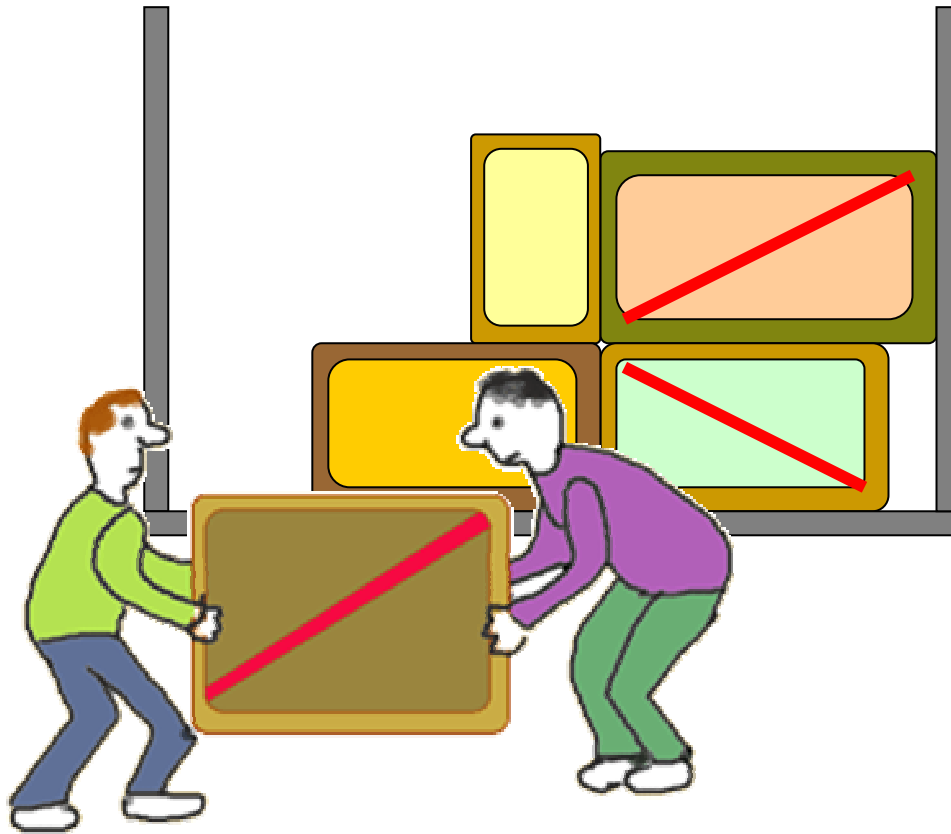
14:25

007	Москва – Владивосток	02:30	02:50	007	Москва – Владивосток	02:30	02:50
874	Москва – Одесса	11:05	11:25	874	Москва – Одесса	11:05	11:25
65	Урюпинск – Киев	12:20	12:45	65	Урюпинск – Киев	12:20	12:45
874	Новосибирск – Бийск	14:45	14:55	874	Новосибирск – Бийск	14:45	14:55
007	Барнаул – Магистрала	16:00	16:10	007	Барнаул – Магистрала	16:00	16:10
874	Москва – Карелия	18:25	18:45	874	Москва – Карелия	18:25	18:45



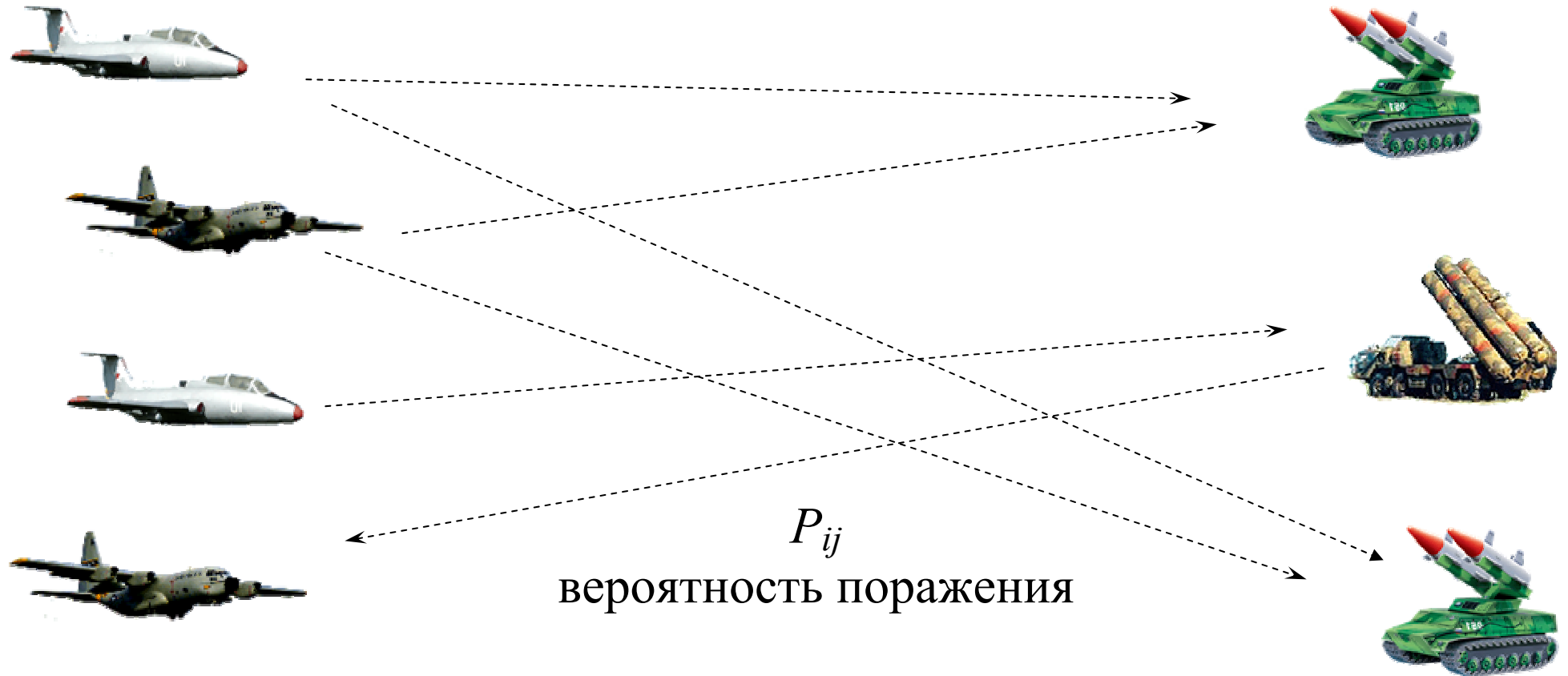
Графики движения поездов, рабочие бригады, ремонт составов

Задачи раскроя и упаковки

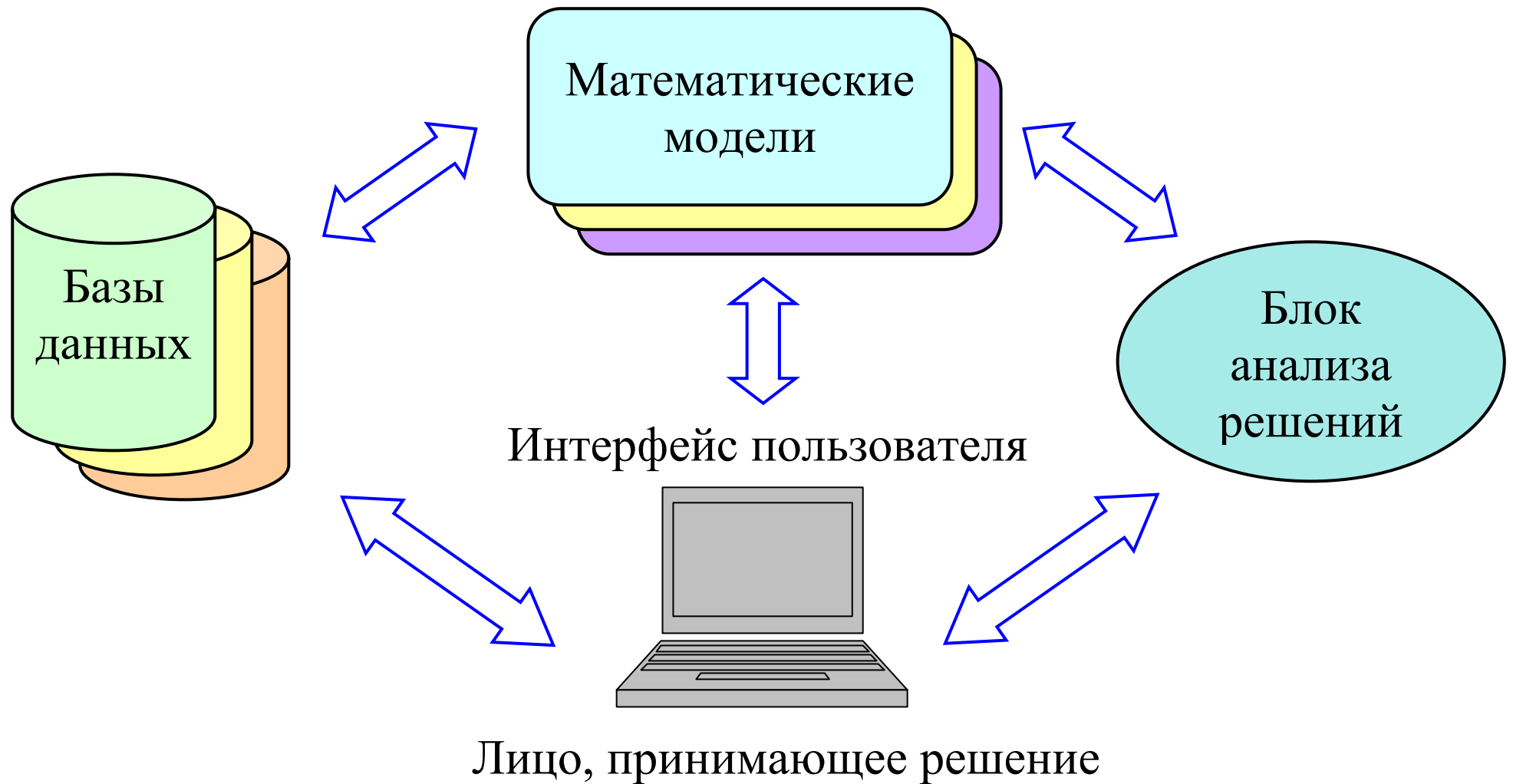


Раскрой пиломатериала, листового железа, станки с ЧПУ

Матричные игры



Системы поддержки решений



Распределительная задача

Имеем

n — число предприятий;

Y — количество единиц некоторого ресурса;

$f_k(x)$ — количество продукции, которое будет произведено на k -м предприятии, если в него будет вложено x единиц ресурса (монотонно неубывающая функция).

Требуется: максимизировать объем продукции

$$f_1(x_1) + \dots + f_n(x_n) \rightarrow \max \quad (1)$$

$$x_1 + \dots + x_n \leq Y \quad (2)$$

$$x_i \geq 0, \text{ целые, } i = 1, \dots, n. \quad (3)$$

Идея динамического программирования (ДП)

Метод ДП (Р. Беллман, В.С. Михалевич, Н.З. Шор) можно трактовать как алгоритмическую версию рассуждений по индукции.

Пусть $s_k(y)$, $1 \leq k \leq n$, $0 \leq y \leq Y$, — оптимальное значение целевой функции задачи (1) – (3), где n заменено на k , Y заменено на y .

Требуется найти $s_n(Y)$ и набор переменных, на котором достигается это значение.

ТЕОРЕМА 1. Пусть f_1, \dots, f_n — монотонно неубывающие функции. Тогда справедливы следующие *рекуррентные соотношения*:

$$s_1(y) = f_1(y), \quad 0 \leq y \leq Y; \quad (4)$$

$$s_k(y) = \max \{s_{k-1}(y-x) + f_k(x) \mid 0 \leq x \leq y\}, \quad 2 \leq k \leq n, \quad 0 \leq y \leq Y, \quad (5)$$

Доказательство: Соотношение (4) очевидно. По определению

$$s_k(y) \geq \max \{s_{k-1}(y-x) + f_k(x) \mid 0 \leq x \leq y\}.$$

Пусть теперь (x_1^*, \dots, x_k^*) — такой вектор, что $x_1^* + \dots + x_k^* \leq y$ и

$$s_k(y) = f_1(x_1^*) + \dots + f_k(x_k^*).$$

Поскольку $s_{k-1}(y - x_k^*) \geq f_1(x_1^*) + \dots + f_{k-1}(x_{k-1}^*)$, имеем

$$s_k(y) = f_1(x_1^*) + \dots + f_k(x_k^*) \leq s_{k-1}(y - x_k^*) + f_k(x_k^*). \quad \blacksquare$$

Алгоритм ДП вычисляет множество $S_k = \{s_k(y) \mid 0 \leq y \leq Y\}$, $k = 1, \dots, n$ с помощью соотношений (4) и (5), где на каждом шаге оптимизируется ровно одна переменная.

Процесс вычисления S_1, \dots, S_n называется *прямым ходом* алгоритма.

Число операций $\approx Y^2 n$

Память $\approx Y n$.

y	$S_1(y)$	$S_2(y)$	\dots	$S_n(y)$
0				
1				
2				
\vdots				
Y				$S_n(Y)$

При *обратном ходе* алгоритма вычисляются значения (x_n^*, \dots, x_1^*) , с учетом того, что уже известны $S_k(y)$. Например, x_n^* определяется из уравнения $s_n(Y) = f_n(x_n^*) + s_{n-1}(Y - x_n^*)$ и так далее.

Число операций $\approx Y n$. Память $\approx Y n$.

Характеристики алгоритмов

Для оценки качества алгоритмов будем использовать два параметра:

T_A — *трудоемкость* (число элементарных операций алгоритма A);

P_A — требуемый *объем памяти*.

Элементарная операция — одна из арифметических операций: сложение, вычитание, умножение, деление или логическая операция сравнение двух чисел.

Нас будет интересовать зависимость параметров алгоритма от длины записи исходных данных задачи с точностью до порядка величин.

Пример: При $T = 3/2 n^2$, будем писать $T = O(n^2)$ или $T \approx n^2$.

Полиномиальные алгоритмы

Определение. Алгоритм A называют *полиномиальным*, если его трудоемкость T_A ограничена полиномом от длины записи исходных данных, то есть существует константа $c > 0$ и натуральное число k такие, что $T_A \leq cL^k$, где L — длина записи исходных данных.

Пример: Пусть $f_i(x_i) = a_i x_i$, тогда
$$L = \sum_{i=1}^n \log a_i + \log Y,$$

но $T_{\text{ДП}} = O(Y^2 n)$, то есть алгоритм ДП не является полиномиальным.

Обобщим задачу (1)–(3):

$$f_1(x_1) + \dots + f_n(x_n) \rightarrow \max \quad (1')$$

$$h_1(x_1) + \dots + h_n(x_n) \leq Y \quad (2')$$

$$a_i \geq x_i \geq 0, \text{ целые, } i = 1, \dots, n. \quad (3')$$

Если $h_i(x)$ — целочисленные монотонно неубывающие функции, то вместо (4)–(5) можно использовать следующие *рекуррентные соотношения*:

$$s_1(y) = f_1(x^*), \text{ где } x^* = \max \{x \leq a_1 \mid h_1(x) \leq y\}, 0 \leq y \leq Y; \quad (4')$$

$$s_k(y) = \max_{\{x \leq a_k \mid h_k(x) \leq y\}} \{f_k(x) + s_{k-1}(y - h_k(x))\}, \quad 2 \leq k \leq n, \quad 0 \leq y \leq Y. \quad (5')$$

Упражнение 1. Доказать справедливость соотношений (4')–(5').

Обратная задача — поиск наименьших затрат на получение заданного количества продукции:

$$h_1(x_1) + \dots + h_n(x_n) \rightarrow \min \quad (6)$$

$$f_1(x_1) + \dots + f_n(x_n) \geq D \quad (7)$$

$$a_i \geq x_i \geq 0, \text{ целые, } i = 1, \dots, n. \quad (8)$$

Если $f_k(x)$ — целочисленные монотонно неубывающие функции, то для решения задачи (6)–(8) можно использовать идеи динамического программирования.

Пусть $f_i^{-1}(d) = \min \{0 \leq x \leq a_i \mid f_i(x) \geq d\}$.

Для $1 \leq k \leq n$, $0 \leq d \leq D$ обозначим через $t_k(d)$ — оптимальное решение задачи (6)–(8), в которой n заменено на k , а D заменено на d .

Требуется найти $t_n(D)$.

Рекуррентные соотношения

$$t_1(d) = \begin{cases} \infty, & \text{если } f_1(a_1) < d, \\ h_1(f_1^{-1}(d)), & \text{если } f_1(a_1) \geq d, \end{cases} \quad 0 \leq d \leq D, \quad (9)$$

$$t_k(d) = \min \{t_{k-1}(d - f_k(x)) + h_k(x) \mid 0 \leq x \leq a_k, x \leq f_k^{-1}(d)\}, \quad (10)$$
$$k \geq 2, \quad 0 \leq d \leq D.$$

Упражнение 2. Доказать справедливость соотношений (9)–(10).

ТЕОРЕМА 2: Предположим, что D — наибольшее число, для которого оптимальное значение целевой функции задачи (6)–(8) не превосходит Y . Тогда оптимальное значение целевой функции задачи (1')–(3') равно D .

Доказательство: Пусть D удовлетворяет условию теоремы и (x_1^*, \dots, x_n^*) — соответствующее решение задачи (6)–(8).

Значит

$$f_1(x_1^*) + \dots + f_n(x_n^*) \geq D \text{ и } h_1(x_1^*) + \dots + h_n(x_n^*) \leq Y.$$

Следовательно, D не превосходит оптимального решения D_1 задачи (1')–(3'). Если бы D_1 было больше D , то решение задачи (6)–(8), в которой D заменено на D_1 , тоже не превышало бы Y , что противоречит максимальнойности D . ■