Сводка результатов анализа эффективности решателей

Предложения по наименованию пакета:

- Бустер-пакет ZyOpt решения задач смешенного линейного программирования,
- Бустер-пакет ZyOpt решения задач экстримальной комбинаторики,
- Бустер-пакет ZyOpt решения задач комбинаторной оптимизации.

Описание пакета Классические проприетраные (CPLEX, GUROBI etc.) и открытые (к примеру, HiGHS, SCIP, CBC) решатели задач смешанного линейного программирования по сути представлют собой эффективно реализованный (с некоторыми доработками) метод ветвей-и-границ, а также набор эвристик (FEASPUMP, FARKAS, RENS, GINS etc.), помогающих решателю сфокусироваться на допустимости решения, его оптимальности и пр. Эти методы хорошо изучены и многие годы подтверждают свою эффективность на практике.

Однако, часто встречаются группы / семейства проблем, на которых только этих методов оказывается не достаточно. Анализ перспективных направлений развития решателей смешанного целочисленного программирования показал, что наибольший интерес в последние годы представляют приемы построения «теплого старта» (на базе классического метода ветвей-и-границ).

Пакет ZyOpt как раз и представляет собой набор высокоуровневых эвристик построения *стартовой точки поиска решения* на базе различных стратегий фиксации переменных в решении без учета ограничений целочисленности, включая полуэмпирические стратегии и стратегии, основанные на методах классического машинного обучения. В текущей реализации пакета методы машинного обучения используются для решения задачи детектирования «квазинулевых» переменных релаксированного решения (то есть переменных, которые принимают нулевое значение в релаксированном решении, но в целочисленном решении принимают значения отличные от нуля). Такие переменные как правило составляют небольшую долю от общего числа, но существенно снижают эффективность процедуры поиска.

Другими словами, ключевая особенность ZyOpt заключается в том, что процедура поиска, как и обычно, опирается на связку «метод ветвей-и-границ + базовые эвристики», но ускорение достигается:

- о за счет агрессивного снижения размерности задачи,
- о и эвристического выбора стартовой точки на базе фиксации переменных.

ZyOpt поставляется в виде обычного Python-пакета и устанавливается как зависимость проекта. Но при необходимости может поставляться в виде Docker-образа или web-сервиса.

ZyOpt мультиплатформенный, так как основывается на мультиплатформенных решателях HiGHS и SCIP, однако вычислительные эксперименты показывают, что более высоких метрик качества удается добиться на базе Unix-подобных операционных системах.

Используя интерфейс решателей HiGHS и SCIP, пакет ZyOpt может поддерживать обычные типы переменных (вещественные, бинарные и целочисленные), а также их полуаналоги – полувещественные и полуцелочисленные переменные.

ZyOpt допускает пользовательскую конфигурацию как на уровне настроек решателя, так и на уровне стратегий поиска решения. При необходимости можно собрать свою собственную реализацию метода с использованием инетрфейса решателя SCIP.

по всему набору проблем. Проблемы сгруппированы по шифру завода и приведены в порядке «от простого к сложному» Таблица 1. Сводка отклонений от решений СРІЕХ 12.8.0.0

		B	ерхняя граница	xe $eeg)$ $xnнemed$	Верхняя граница решения (без экспоненциальной части)	lcmu
Π роблемы группы $UK\Pi$	T, mun	CBC	$ CBC SCIP^a$	HiGHS^b	ZyOpt	CPLEX^c
2023_08_YANOS_2693.mps	1.0	8	1.05(-0.16%)	1.05(-0.07%)	1.05(-0.10%)	1.05
2023_07_YANOS_2690.mps	1.0	8	8	1.23(-0.08%)	1.23(+0.01%)	1.23
2023_06_YANOS_KF_NB.mps	3.0	8	4.16(-1.92%)	4.17(-1.98%)	4.13(-1.22%)	4.09
2023_06_YANOS_2688.mps	5.0	8	3.96(-0.47%)	3.96(-0.56%)	3.99(-1.33%)	3.94
2023_06_YANOS_KF_NB_Int_Idle.mps	5.0	8	4.17(-1.92%)	8	4.20(-2.52%)	4.09
2023_06_MNPZ_2673_KF_NB.mps	2.0	8	8	6.66(-2.71%)	6.68(-2.91%)	6.49
2023_06_MNPZ_2673.mps	3.0	8	8	6.53(-0.58%)	6.61(-1.82%)	6.49
2023_06_ONPZ_2683_no_KF_NPZ.mps	5.0	8	8	8	7.67(+10.35%)	8.55
2023_03_0NPZ_1615.mps	0.09	8	8	8	1.31(+21.72%)	1.67
2023_03_0NPZ_1615_Slacks_KF_NPZ.mps	0.09	8	8	8	10.13(-24.10%)	8.17
2023_06_ONPZ_2683_Slacks_KF_NPZ.mps	0.09	8	8	6.40(+52.05%)	3.54(+73.48%)	13.34
2023_03_3NPZ_1615_Slacks_KF_NPZ.mps	120.0	8	8	2.64(-6.16%)	1.36(+45.41%)	2.49

T- Полное время расчета проблемы

 $\begin{aligned} a &- \text{SCIP 8.0.3} \\ b &- \text{HiGHS 1.5.3} \\ c &- \text{CPLEX 12.8.0.0 (база для сравнения)} \end{aligned}$

Таблица 2. Сводка отклонений от решений СР
LEX 12.8.0.0 по набору проблем группы СОП

емы	вишиде	epynnu Pemamenu	Hижная	Bepxняя	3a3op, %	% Полное время
СОП			граница	граница		расчета, мин
out_1.mps		CBC	44.69	53.0	18.6	10.0^d
1		$SCIP^a$	48.90	53.0	8.4	10.0^d
I		HiGHS^b	46.34	53.0	12.6	10.0^d
1		CPLEX^c	52.0	53.0	1.9	10.0^d
I		ZyOpt^h	49.11	53.0	7.13	10.0^d

a - SCIP 8.0.3

 $b-{\rm HiGHS\ 1.5.3}$

 $c-{\rm CPLEX}$ 12.8.0.0 (база для сравнения)

d — Решение остановлено по времени

f — Решение остановлено по нулевому зазору

 $h-{\tt RELAX-PHASE: HiGHS \ (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION+PERTURBATION, \ p=0.7}$

Таблица 3. Сводка отклонений от решений СРLEX 12.8.0.0 по набору проблем https://miplib.zib.de/ MIPLIB 2017

ynnы	\mid Pewamero	Hижная	Верхняя	3a3op, %	Зазор, % Отклонение	Полное время
MIPLIB 2017		граница	граница		верхней гра-	расчета, мин
					то прин	
					оптимального	
					значения, %	
csched008.mps	CBC	171.0	183.0	7.0	-5.8	120.0^{d}
I	$SCIP^a$	172.0	173.0	9.0	0.0	10.0^d
I	HiGHS^b	173.0	173.0	0.0	0.0	9.29^{f}
I	CPLEX^c	172.0	173.0	9.0	0.0	10.0^d
I	ZyOpt^h	174.0	174.0	0.0	*9.0-	$1.15^f(+88.5\%)$
csched010.mps	CBC	392.0	408.0	4.1	0.0	120.0^d
I	$SCIP^a$	408.0	408.0	0.0	0.0	39.1^{d}
ı	HiGHS^b	408.0	408.0	0.0	0.0	30.7^f
I	CPLEX^c	408.0	408.0	0.0	0.0	15.2^f
ı	ZyOpt^h	431.0	431.0	0.0	-5.6^{*}	$8.0^f(+47.4\%)$
atlanta-ip.mps	CBC	86.04	92.0	6.9	2.2	120.0^d
I	$SCIP^a$	86.9	0.06	3.6	0.0	120.0^d
ı	HiGHS^b	85.8	91.0	6.1	1.1	120.0^d
I	CPLEX^c	0.06	0.06	0.0	0.0	59.28^{f}
1	ZyOpt^h	95.0	95.0	0.0	-5.6^{*}	$0.19^f(+99.7\%)$

a - SCIP 8.0.3

 $b-{
m HiGHS}$ 1.5.3

 $c-{
m CPLEX}$ 12.8.0.0 (база для сравнения)

d- Решение остановлено по времени

f — Решение остановлено по нулевому зазору

h-RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION+PERTURBATION, p=0.5 * - Для того чтобы получить *оптимальное* решение за меньшее время,

можно подбрирать значения гиперпараметров решателя на калибровочных проблемах

Таблица 4. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_07_YANOS_2690.mps

NVars: 106674 (NBinVars: 0, NIntVars: 3069) NConss: 106029 NonzeroDensity: $2.5376 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^7$	Целевая функция первого допустимо- го решения, $\times 10^7$	Время поиска пер- вого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	1.00^{b}	1.22864	_	
CBC	1.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	1.00^{b}	∞	_	_
HiGHS 1.5.3	1.00^{b}	1.229663 (-0.083%)	1.229663	0.793
ZyOpt^c	1.00^{b}	1.228501 (+0.011%)	1.231341	0.118

- а База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 5. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_08_YANOS_2693.mps

NVars: 89608 (NBinVars: 0, NIntVars: 2480) NConss: 87714 NonzeroDensity: $2.9449 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^7$	Целевая функция первого допустимо- го решения, $\times 10^7$	Время поиска пер- вого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	1.00^{b}	1.047947		
CBC	1.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	1.00^{b}	$1.049621 \ (-0.159\%)$	1.049621	0.65
HiGHS 1.5.3	1.00^{b}	$1.048638 \ (-0.065\%)$	1.089204	0.213
ZyOpt^c	1.00^{b}	$1.048957 \ (-0.096\%)$	1.059473	0.026

- a База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 6. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_06_YANOS_2688.mps

NVars: 82442 (NBinVars: 0, NIntVars: 2790) NConss: 95839 NonzeroDensity: $3.0860 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^6$	Целевая функция первого допустимо- го решения, $\times 10^6$	Время поиска пер- вого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	5.00^{b}	3.937876	_	_
CBC	5.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	5.00^{b}	3.956423 (-0.471%)	4.137448	0.516
HiGHS 1.5.3	5.00^{b}	$3.959913 \ (-0.559\%)$	4.555539	0.251
ZyOpt^c	5.00^{b}	3.990119 (-1.326%)	4.366211	0.563

- a База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 7. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_06_YANOS_KF_NB.mps

NVars: 87071 (NBinVars: 0, NIntVars: 3616) NConss: 100468 NonzeroDensity: $2.9191 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^6$	Целевая функция первого допустимо-го решения, $\times 10^6$	Время поиска первого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	3.00^{b}	4.084211	_	_
CBC	3.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	3.00^{b}	4.162588 (-1.919%)	4.371621	0.916
HiGHS 1.5.3	3.00^{b}	4.165121 (-1.981%)	4.165115	1.293
ZyOpt^c	3.00^{b}	$4.133916 \; (-1.216\%)$	4.133916	2.116

- a База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 8. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_06_YANOS_KF_NB_Int_Idle.mps

NVars: 87071 (NBinVars: 0, NIntVars: 6398) NConss: 100468 NonzeroDensity: $2.9191 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^6$	Целевая функция первого допустимо-го решения, $\times 10^6$	Время поиска первого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^a$	5.00^{b}	4.0938	_	_
CBC	5.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	5.00^{b}	4.172394 (-1.919%)	4.258917	0.716
HiGHS 1.5.3	5.00^{b}	∞	_	_
ZyOpt^c	5.00^{b}	4.197091 (-2.523%)	4.265474	0.418

- a База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 9. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_06_MNPZ_2673.mps

NVars: 84821 (NBinVars: 0, NIntVars: 4588) NConss: 81624 NonzeroDensity: $3.1204 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время	Верхняя граница	Целевая функция	Время поиска пер-
	расчета, мин	$peшeнus, \times 10^5$	первого допустимо-	вого допустимого
			го решения, $\times 10^5$	решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^a$	3.00^{b}	6.487557	_	_
CBC	3.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	3.00^{b}	∞	_	_
HiGHS 1.5.3	3.00^{b}	$6.52544 \ (-0.583\%)$	6.68203	0.613
ZyOpt^c	3.00^{b}	$6.60533 \ (-1.815\%)$	6.66437	0.161

- a База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 10. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_06_MNPZ_2673_KF_NB.mps

NVars: 88344 (NBinVars: 0, NIntVars: 5390) NConss: 85147 NonzeroDensity: $2.9853 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^5$	Целевая функция первого допустимо-го решения, $\times 10^5$	Время поиска первого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	2.00^{b}	6.487557	_	_
CBC	2.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	2.00^{b}	∞	_	_
HiGHS 1.5.3	2.00^{b}	$6.66327 \ (-2.708\%)$	6.99123	0.521
ZyOpt^c	2.00^{b}	$6.67619 \ (-2.907\%)$	6.78893	0.166

- a База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 11. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_06_0NPZ_2683_no_KF_NPZ.mps

NVars: 254389 (NBinVars: 0, NIntVars: 25410) NConss: 202597 NonzeroDensity: $1.3999 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^6$	Целевая функция первого допустимо-го решения, $\times 10^6$	Время поиска первого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	5.00^{b}	8.551236	_	_
CBC	5.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	5.00^{b}	∞	_	_
HiGHS 1.5.3	5.00^{b}	∞	_	_
ZyOpt^c	5.00^{b}	7.666215 (+10.349%)	7.751731	0.256

- a База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 12. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_03_0NPZ_1615.mps

 ${\tt NVars:~320066~(NBinVars:~62,~NIntVars:~32972)~NConss:~252539~NonzeroDensity:~1.1534\cdot10^{-5}}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^7$	Целевая функция первого допустимо- го решения, $\times 10^7$	Время поиска пер- вого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	60.00^{b}	1.671514		_
CBC	60.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	60.00^{b}	∞	_	_
HiGHS 1.5.3	60.00^{b}	∞	_	_
ZyOpt^c	60.00^{b}	1.308493 (+21.718%)	1.308493	15.463

- a База для сравнения
- **b** Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 13. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_03_0NPZ_1615_Slacks_KF_NPZ.mps

NVars: 321478 (NBinVars: 62, NIntVars: 32972) NConss: 252539 NonzeroDensity: $1.1500 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^7$	Целевая функция первого допустимо-го решения, $\times 10^7$	Время поиска первого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	60.00^{b}	8.166203	_	_
CBC	60.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	60.00^{b}	∞	_	_
HiGHS 1.5.3	60.00^{b}	∞	_	_
ZyOpt^c	60.00^{b}	10.133944 (-24.096%)	15.871435	4.156

- a База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 14. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_06_0NPZ_2683_Slacks_KF_NPZ.mps

NVars: 256459 (NBinVars: 0, NIntVars: 26100) NConss: 203287 NonzeroDensity: $1.4414 \cdot 10^{-5}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^8$	Целевая функция первого допустимо-го решения, $\times 10^8$	Время поиска первого допустимого решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	60.00^{b}	13.34046	_	_
CBC	60.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	60.00^b	∞	_	_
HiGHS 1.5.3	60.00^{b}	6.396971 (+52.048%)	6.396971	21.746
ZyOpt^c	60.00^b	3.537829 (+73.48%)	23.878683	0.413

- а База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 15. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме 2023_03_3NPZ_1615_Slacks_KF_NPZ.mps

NVars: 443669 (NBinVars: 93, NIntVars: 42835) NConss: 360300 NonzeroDensity: $8.2112 \cdot 10^{-6}$

Решатель	Полное время	Верхняя граница	Целевая функция	Время поиска пер-
	расчета, мин	$peшeния, \times 10^9$	первого допустимо-	вого допустимого
			го решения, $\times 10^9$	решения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	120.00^{b}	2.486351	_	_
CBC	120.00^{b}	∞	_	_
SCIP 8.0.3	120.00^{b}	∞	_	_
HiGHS 1.5.3	120.00^{b}	2.639431 (-6.156%)	2.639431	2.461
ZyOpt^c	120.00^{b}	1.357399 (+45.405%)	1.357399	10.378

- a База для сравнения
- **b** Решение остановлено по времени
- c RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION

Таблица 16. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме https://miplib.zib.de/instance_details_csched008.html csched008.mps

 ${\tt NVars:}~1536~({\tt NBinVars:}~1284,~{\tt NIntVars:}~0)~{\tt NConss:}~351~{\tt NonzeroDensity:}~0.0105$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^0$	Целевая функция $nepвoro\ donycmuмого$ $peшeния, \times 10^0$	Время поиска перво- го допустимого ре- шения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	10.00^{b}	173	_	_
CBC	120.00^{b}	183	_	_
SCIP 8.0.3	10.00^{b}	173	185	0.416
HiGHS 1.5.3	9.29	173	189	0.021
ZyOpt^d	1.14^{c}	$174 \ (-0.578\%)$	186	0.026

- а База для сравнения
- Решение остановлено по времени
- c Решение остановлено по нулевому зазору
- d RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION+PERTURBATION, p = 0.5

Таблица 17. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме https://miplib.zib.de/instance_details_csched010.html csched010.mps

NVars: 1758 (NBinVars: 1457, NIntVars: 0) NConss: 351 NonzeroDensity: 0.0103

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^0$	Целевая функция первого допустимого решения, $\times 10^0$	Время поиска перво- го допустимого ре- шения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	15.20^{c}	408	_	_
CBC	120.00^{b}	408	_	_
SCIP 8.0.3	39.10^{c}	408	552	0.666
HiGHS 1.5.3	30.70^{c}	408	598	2.281
ZyOpt^d	$8.00^{c}(+47.37\%)$	431 (-5.637%)	653	0.838

- а База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c Решение остановлено по нулевому зазору
- d RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION+PERTURBATION, p = 0.5

Таблица 18. Сводка результатов анализа эффективности решателей на проблеме https://miplib.zib.de/instance_details_atlanta-ip.html atlanta-ip.mps

NVars: 48738 (NBinVars: 46667, NIntVars: 106) NConss: 351 NonzeroDensity: $2.4314 \cdot 10^{-4}$

Решатель	Полное время расчета, мин	$Bерхняя$ граница решения, $\times 10^0$	Целевая функция $nepвoro\ donycmumoro$ $peшения, \times 10^0$	Время поиска перво- го допустимого ре- шения, мин
CPLEX $12.8.0.0^{a}$	59.28^{c}	90	_	_
CBC	120.00^{b}	92	_	_
SCIP 8.0.3	120.00^{b}	90	102	3.783
HiGHS 1.5.3	120.00^{b}	91	94	2.75
ZyOpt^d	$0.19^{c}(+99.68\%)$	95 (-5.555%)	106	0.008

- a База для сравнения
- b Решение остановлено по времени
- c Решение остановлено по нулевому зазору
- d RELAX-PHASE: HiGHS (ipm), MILP-PHASE: HiGHS, STRATEGY: FIXATION+PERTURBATION, p = 0.5