

组合优化理论

第8章 装箱问题

主讲人,陈安龙



第8章 装箱问题

- § 1 装箱问题的描述
- § 2 装箱问题的最优解值下界
- § 3 装箱问题的近似算法



第8章 装箱问题

装箱问题(Bin Packing)是一个经典的组合优化问题,有着广泛的应用,在日常生活中也屡见不鲜.

§1 装箱问题的描述

设有许多具有同样结构和负荷的箱子 B_1 , B_2 , ... 其数量足够供所达到目的之用.每个箱子的负荷(可为长度、重量 etc.)为 C,今有 n 个负荷为 w_j , $0 < w_j < C$ j=1, 2, ..., n 的物品 J_1 , J_2 , ..., J_n 需要装入箱内. **装箱问题**:

是指寻找一种方法,使得能以最小数量的箱子数将 J_1 , J_2 , ..., J_n 全部装入箱内.

§1 装箱问题的描述

由于 $w_i < C$,所以BP的最优解的箱子数不超过n.

设
$$y_i = \begin{cases} 1 & \text{箱子 } B_i \text{ 被使用} \\ 0 & \text{否则} \end{cases}$$
 $i = 1 \sim n;$

$$x_{ij} = \begin{cases} 1 & \text{物品 } J_j \text{ 放入箱子 } B_i \text{ 中} \\ 0 & \text{否则} \end{cases}$$

则装箱问题的整数线性规划模型为:

$$\mathbf{min} \quad z = \sum_{i=1}^{n} y_i$$

(BP) s.t.
$$\sum_{i=1}^{n} w_{j} x_{ij}^{i=1} \le C y_{i}$$
 $i = 1 \sim n$ (1)

$$\sum_{i=1}^{n} x_{ij} = 1 j = 1 \sim n (2)$$

 $i, j = 1 \sim n.$

约束条件(1)表示: 一旦箱子 B_i 被使用, 放入 B_i 的物品总负 荷不超过C;

约束条件(2)表示: 每个物品恰好放入一 个箱子中.

$$y_i = 0$$
 or 1, $x_{ij} = 0$ or 1 $i, j = 1 \sim n$.



上述装箱问题是这类问题最早被研究的,也是提法上最简单的问题,称为一维装箱问题,但 $BP \in NPC$. 装箱问题的其他一些提法:

- 1、在装箱时,不仅考虑长度,同时考虑重量或面积、 体积 etc.即二维、三维、...装箱问题;
- 2、对每个箱子的负荷限制不是常数 C; 而是 C_i , $i=1\sim n$.
- 3、物品 J_1 , J_2 , ..., J_n 的负荷事先并不知道,来货是 随到随装; 即 在线(On-Line)装箱问题;
- 4、由于场地的限制,在同一时间只能允许一定数量的 箱子停留现场可供使用,etc.



BP 的应用举例:

- 1、下料问题 轧钢厂生产的线材一般为同一长度, 而用户所需的线材则可能具有各种不同的尺寸, 如何根据用户提出的要求, 用最少的线材截出所需的定货;
- 2、二维 *BP* 玻璃厂生产出**长宽一定的大平板玻璃**,但用户所需玻璃的长宽可能有许多差异,如何根据用户提出的要求,用最少的平板玻璃**截出所需的定货**;
- 3、计算机的存贮问题 如要把大小不同的共 10 MB 的文件拷贝到磁盘中去,而每张磁盘的容量为 1.44 MB,已知每个文件的字节数不超过 1.44 MB,而且一个文件不能分成几部分存贮,如何用最少的磁盘张数完成.
- **4、**生产流水线的平衡问题 给定流水节拍 C,如何设置最少的工作站,(按一定的紧前约束)沿着流水线将任务分配到各工作站上.称为带附加优先约束的 BP.

BP 是容量限制的工厂选址问题的特例之一.



§ 2 装箱问题的最优解值下界

由于 *BP* 是 *NPC* 问题,所以求解考虑 一是尽可能改进简单的穷举搜索法,减少搜索工作量.如: 分支定界法; 二是启发式(近似)算法.

(近似) 算法. min
$$z = \sum_{i=1}^{n} y_i$$

(BP) s.t. $\sum_{j=1}^{n} w_j x_{ij} \le Cy_i$ $i = 1 \sim n$ (1) $\sum_{j=1}^{n} x_{ij} = 1$ $j = 1 \sim n$ (2) $y_i = 0$ or 1, $x_{ij} = 0$ or 1 $i, j = 1 \sim n$.

显然
$$x_{ii} = 1$$
, $x_{ij} = 0$ $(i \neq j)$, $y_i = \frac{w_i}{C}$, $i, j = 1 \sim n$.

是松弛问题的最优解,最优值为: $z_{opt} = \frac{1}{C} \sum_{i=1}^{n} w_i$



§ 2 装箱问题的最优解值下界

Theorem 8.1 BP 最优值的一个下界为 $L_1 = \left| \frac{1}{C} \sum_{i=1}^{n} w_i \right|$

 $\begin{bmatrix} a \end{bmatrix}$ 表示不小于 a 的最小整数.

Theorem 8.2

对于 BP 的任一实例 I,设 a 是任意满足 $w = \min \{ w_j \mid w_j \in I \}$ $0 \le a \le \frac{C}{2}, a \le w$ 的整数

记
$$I_1 = \{ \text{物品 } j | w_j > C - a \}, \quad I_2 = \{ \text{物品 } j | C - a \ge w_j > \frac{C}{2} \},$$

$$I_3 = \left\{ \text{\mathfrak{h} \mathbb{H} } j \middle| \frac{C}{2} \geq w_j \geq a \right\},$$

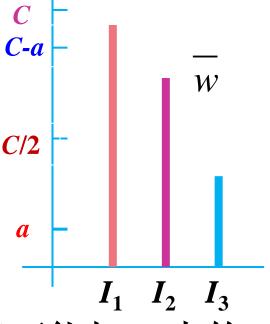
是最优解的一个下界,



Proof: 仅考虑对 I_1,I_2,I_3 中物品的装箱.

 $I_1 \cup I_2$ 中物品的长度大于C/2,每个物品需单独放入一个箱子,这就需要 $|I_1| + |I_2|$ 个箱子.

又: I_3 中每个物品长度至少为a,



: 它不能与 I_1 中的物品共用箱子,但可能与 I_2 中的物品共用箱子,由于放 I_2 中物品的 $\left|I_2\right|$ 个箱子的剩余总长度为 $\overline{C} = \left|I_2\right|C - \sum w_j$

在最好的情形下, \overline{C} 被 I_3 中的物品全部充满,故剩下总长度 $\overline{W} = \sum_{j \in I_3} w_j - \overline{C}$ 将另外至少 $\left[\frac{\overline{W}}{C}\right]$ 个附加的箱子.



w可能为负数

$$\therefore L(a) = |I_1| + |I_2| + \max \left\{ 0, \left[\frac{1}{C} (\sum_{j \in I_3} w_j - (|I_2|C - \sum_{j \in I_2} w_j)) \right] \right\}$$

是最优解的一个下界.

问
$$L(a) \ge L_1 = \left\lceil \frac{1}{C} \sum_{i=1}^n w_i \right\rceil$$
 ?

§ 2 装箱问题的最优解值下界

Corollary 8.1 记
$$L_2 = \max \left\{ L(a) \middle| 0 \le a \le \frac{C}{2}, a$$
 为整数 \right\}

则 L_2 是装箱问题的最优解的一个下界,且 $L_2 \ge L_1$.

Proof: L_2 为最优解的下界是显然的.

(若证明 $L(0) \ge L_1$,则可得 $L_2 \ge L_1$)

$$L(a) = |I_1| + |I_2| + \max \left\{ 0, \left[\frac{1}{C} (\sum_{j \in I_3} w_j - (|I_2|C - \sum_{j \in I_2} w_j)) \right] \right\}$$

当 a = 0 时, $I_1 = \emptyset$, $I_2 \cup I_3$ 是所有物品.

$$L(0) = 0 + |I_2| + \max \left\{ 0, \left[\frac{1}{C} (\sum_{j=1}^n w_j - |I_2|C) \right] \right\}$$
$$= |I_2| + \max \left\{ 0, L_1 - |I_2| \right\} = \max \left\{ |I_2|, L_1 \right\} \ge L_1$$

$$\therefore L_2 \ge L(0) \ge L_1$$

§3 装箱问题的近似算法

一、NF(Next Fit)算法

设物品 J_1 , J_2 ,..., J_n 的长度分别为 w_1 , w_2 ,..., w_n 箱子 B_1 , B_2 , ...的长均为 C, 按物品给定的顺序装箱.

先将 J_1 放入 B_1 , 如果 $w_1 + w_2 \le C$ 则将 J_2 放入 B_1 ...

如果 $w_1 + w_2 + \dots + w_j \le C$ 而 $w_1 + w_2 + \dots + w_j + w_{j+1} > C$

则 B_1 已放入 J_1 , J_2 ,..., J_j , 将其关闭,将 J_{j+1} 放入 B_2 .

同法进行,直到所有物品装完为止.计算复杂性为O(n).

- 特点: 1、按物品给定的顺序装箱;
 - 2、关闭原则 .



对当前要装的物品 J_i 只关心具有最大下标的已使用过的箱子 B_i 能否装得下?

能.则 J_i 放入 B_j ;否.关闭 B_j , J_i 放入新箱子 B_{j+1} .

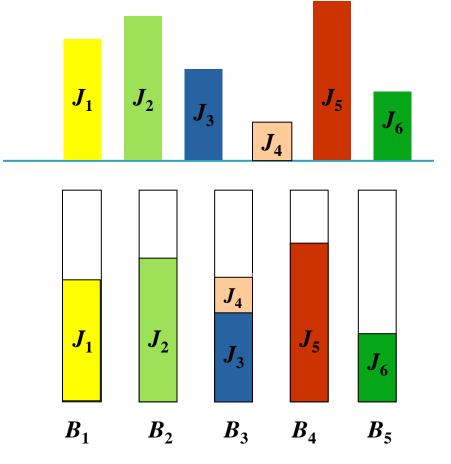
§ 3 装箱问题的近似算法

Example 1 I: C = 10

Solution:

首先,将 J_1 放入 B_1 ; 由于 J_2 在 B_1 中放不下,所以关闭 B_1 ,将 J_2 放入 B_2 , J_3 在 B_2 中放不下(不考虑 B_1 是否能装),所以关闭 B_2 将 J_3 放入 B_3 , ...

物品	J_1	J_2	J_3	J_4	J_5	J_6
w_{j}	6	7	4	2	8	3



 \therefore 解为: $x_{11} = x_{22} = x_{33} = x_{34} = x_{45} = x_{56} = 1$ 其余为零,



Theorem 8.3
$$\frac{z_{NF}(I)}{z_{ont}(I)} \le 2$$

Proof: 设I为任一实例, $z_{opt}(I) = k$. (要证 $z_{NF}(I) \le 2k$)

显然,由
$$k = z_{opt}(I) \ge \frac{1}{C} \sum_{i=1}^{n} w_i$$
 得 $\sum_{i=1}^{n} w_i \le Ck$

反证 如果 $z_{NF}(I) > 2k$, 则 对任意 i = 1, 2, ..., k

由于起用第 2i 个箱子是因为第 2i -1 个箱子放不下第2i

个箱子中第一个物品,因此这两个箱子中物品的总长度

大于C,所以前2k个箱子中物品的总长度大于Ck.

这与
$$\sum_{i=1}^{n} w_i \leq Ck$$
 矛盾. $\therefore \frac{z_{NF}(I)}{z_{opt}(I)} \leq 2$.

§ 3 装箱问题的近似算法

I: C = 10

二、FF (First Fit) 算法

用NF算法装箱,当放入

物品	J_1	J_2	J_3	J_4	J_5	J_6
w_{j}	6	7	4	2	8	3

 J_3 时,仅看 B_2 是否能放入,因 B_1 已关闭,

但事实上, B_1 此时是能放得下 J_3 的.

设物品 J_1 , J_2 ,..., J_n 的长度分别为 w_1 , w_2 ,..., w_n 箱子 B_1 , B_2 , ...的长均为 C, 按物品给定的顺序装箱.

先将 J_1 放入 B_1 , 若 $w_1 + w_2 \le C$, 则 J_2 放入 B_1 , 否则, J_2 放入 B_2 ; 若 J_2 已放入 B_2 , 对于 J_3 则依次检查 B_1 、 B_2 ,若 B_1 能放得下,则 J_3 放入 B_1 ,否则查看 B_2 ,若 B_2 能放得下,则 J_3 放入 B_2 ,否则启用 B_3 , J_3 放入 B_3 .



一般地, J_1 ……, J_j 已放入 B_1 ……, B_i 箱子,对于 J_{j+1} ,则依次检查 B_1 , B_2 ……, B_i ,将 J_{j+1} 放入首先找到的能放得下的箱子,如果都放不下,则启用箱子 B_{i+1} ,将 J_{j+1} 放入 B_{i+1} ,如此继续,直到所有物品装完为止.

特点: 1、按物品给定的顺序装箱;

2、对于每个物品 J_j 总是放在能容纳它的具有最小标号的箱子.

计算复杂性为 O(nlogn).



§ 3 装箱问题的近似算法

$$\frac{z_{FF}(I)}{z_{opt}(I)} \leq \frac{7}{4} .$$

Theorem 8.5

对任意实例 I,
$$z_{FF}(I) \le \frac{17}{10} z_{opt}(I) + 1$$

而且存在 $z_{opt}(I)$ 任意大的实例 I ,使 $z_{FF}(I) \ge \frac{17}{10}(z_{opt}(I)-1)$

$$R_{FF}^{\infty} = \frac{17}{10} .$$



Example 2 I: C=10

$$I: C = 10$$

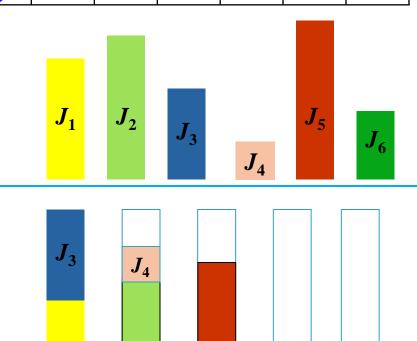
物品	J_1	J_2	J_3	J_4	J_5	J_6
w_{j}	6	7	4	2	8	3

Solution:

首先,将 J_1 放入 B_1 ; 由于 J_2 在 B_1 中放不下,所 以将 J, 放入 B,

对于 J_3 , 先检查 B_1 是否能 容纳下,能. 所以将 J_3 放 $\lambda B_1, \ldots$

· 解为:



 $\boldsymbol{B_3}$

 B_{Λ}

 $\boldsymbol{B_2}$

 $x_{11} = x_{22} = x_{13} = x_{24} = x_{35} = x_{46} = 1$ 其余为零, $z_{FF}(I) = 4$.

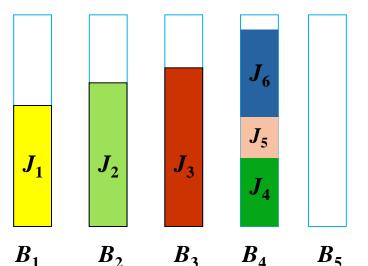
 $\boldsymbol{B_1}$

 B_{5}

Example 3 I: C = 10

$$I: C = 10$$

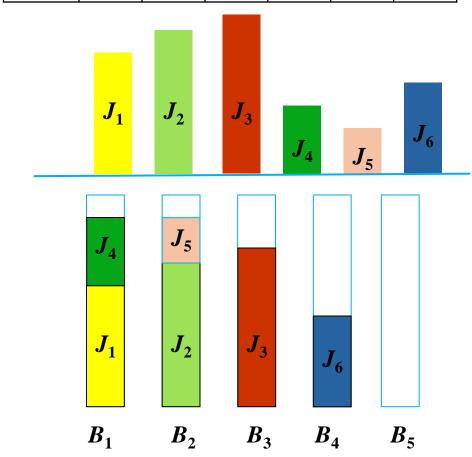
Solution:



用 NF 算法 $z_{NF}(I) = 4$

用 FF 算法 $z_{FF}(I) = 4$

物品	J_1	$oldsymbol{J_2}$	J_3	J_4	J_5	J_6
w_{j}	6	7	8	3	2	4



用 FF 算法装箱, 当放入 J_4 时, B_1 能容纳 J_4 就放入 B_1 , 而事实上,放入 B_2 更好.



三、BF (Best Fit) 算法

与FF算法相似,按物品给定的顺序装箱,区别在于对于每个物品 J_j 是放在一个使得 J_j 放入之后, B_i 所剩余长度为最小者。

即在处理 J_j 时,若 B_1 , B_2 ,..., B_i 非空,而 B_{i+1} 尚未启用,设 B_1 , B_2 ,..., B_i 所余的长度为

 w_1, w_2, \dots, w_i , 若 $w_j > \max_{1 \le k \le i} w_k$ 则将 J_j 放入 B_{i+1} 内; 否则,从 $w_j \le \overline{w}_k$ 的 B_k 中,选取 一个 B_l (1 $\le l \le i$) 使得 $\overline{w}_l - w_j = \min_{\overline{w}_k \ge w_j} (\overline{w}_k - w_j)$ 为最小者.

BF 算法的绝对性能比、计算复杂性与 FF 算法相同.

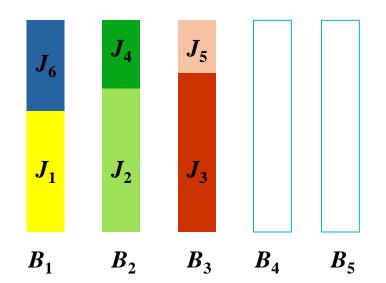
Example 4 I:C=10

$$I: C = 10$$

物品 J_6 3

Solution:

用BF算法



J_1	J_2	J_3	J_4	J_5	J_6

$$\therefore L_1 = \left\lceil \frac{1}{10} \sum_{j=1}^6 w_j \right\rceil = 3$$

解为:

而 $z_{RF}(I) = L_1$, ∴ 此为最优解.

 $x_{11} = x_{22} = x_{33} = x_{24} = x_{35} = x_{16} = 1$ 其余为零, $z_{RF}(I) = 3$.



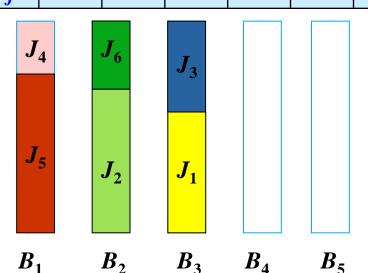
四、FFD (First Fit Decreasing) 算法

FFD 算法是先将物品按长度从大到小排序,然后用 FF 算法对物品装箱.该算法的计算复杂性为 O(nlogn).

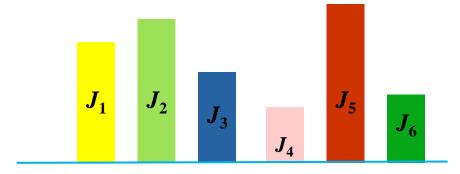


Solution: 已知: $z_{FF}(I) = 4$

物品	J_5	J_2	J_1	J_3	J_6	J_4
w_i	8	7	6	4	3	2



物品	J_1	J_2	J_3	J_4	J_5	J_6
w_j	6	7	4	2	8	3



$$z_{FFD}(I) = 3$$
 是最优的.

NFD 算法? BFD 算法?



Theorem 8.6
$$R_{FFD}(I) = \frac{3}{2}$$
.

Proof: 显然对任意实例 I,有 $z_{FFD}(I) \ge z_{opt}(I)$

记
$$z_{FFD}(I) = l$$
 $z_{opt}(I) = l^*$

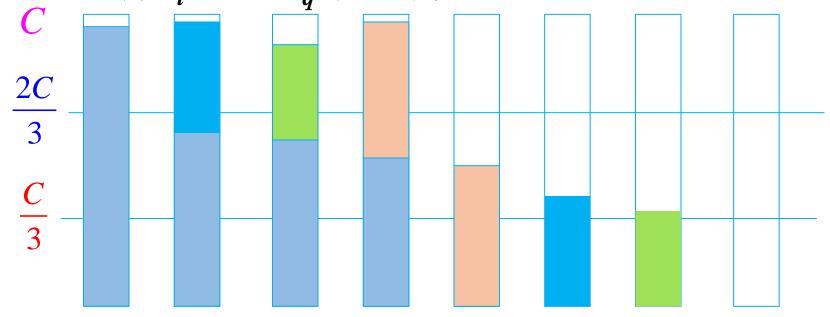
首先证明两个结论:

- (1) FFD 算法所用的第 $\frac{l^*}{C}$ + 1, l^* + 2, ..., l 个箱子中,每个的物品长度不超过 $\frac{c}{3}$;
- 记 w_i 是放入第 l^* + 1个箱子中的**第一个物品**,只需证 $w_i \le \frac{C}{3}$ 用反证法,若不然,则有 $w_1,...,w_{i-1} > \frac{C}{3}$,因此 FFD 算法中前 l^* 个箱子中,每个箱子至多有两个物品.



可证明存在 $k \ge 0$ 使前 k 个恰各含一个物品,后 $l^* - k$ 个箱子各含两个物品、

因为若不然,则存在两个箱子 B_p , B_q , p < q, 使 B_p 有两个物品 w_{t_1} , w_{t_2} ($t_2 > t_1$), B_q 有一个物品 w_{t_3} 因物品已从大到小排列,故 $w_{t_1} \ge w_{t_3}$, $w_{t_2} \ge w_i$, 因此 $C \ge w_{t_1} + w_{t_2} \ge w_{t_3} + w_i$.从而可以将 w_i 放入 B_q 中,矛盾.





因为FFD未将 $w_{k+1},...,w_i$ 放入前k个箱子,说明 其中任一个箱子已放不下, 故在最优解中也至少有 k 个 箱子不含 $w_{k+1},...,w_i$ 中任一个物品.假设就是前k个 箱子,因此在最优解中, w_{k+1}, \ldots, w_{i-1} 也会两两放入第 $k+1,...,l^*$ 个箱子中,且因为这些物品长度大于 $\frac{C}{3}$,所以 每个箱子中只有两个物品,且 $w_i > \frac{C}{3}$ 已放不下。但最 优解中 w_i 必须放入前 l^* 个箱子中,矛盾.故 $w_i \leq \frac{C}{3}$

(2) FFD 算法放入第 $l^* + 1,...,l$ 个箱子中物品数不超过 $l^* - 1$

 $:: \sum_{i=1}^{n} w_i \leq l^*C, \text{ 而如果至少有 } l^* \land \text{ 物品放入第 } l^* + 1, ..., l$

个箱子中,记前 l^* 个物品的长度为 $a_1,...,a_{l^*}$.



记 FFD 算法中前 l^* 个箱子中每个箱子物品总长为 b_j , $j=1\sim l^*$ 显然,对任意 $j=1\sim l^*$, $b_j+a_j>C$ 否则长为 a_i 的物品可放入第 j 个箱子中,因此

所以(2)结论成立.

由(1)、(2) 知FFD 算法比最优算法多用的箱子是用来放至多 l^* -1个物品,而每个物品长不超过 $\frac{C}{3}$,因此



$$\frac{z_{FFD}(I)}{z_{opt}(I)} \leq \frac{z_{opt}(I) + \left\lceil \frac{z_{opt}(I) - 1}{3} \right\rceil}{z_{opt}(I)} \leq 1 + \frac{z_{opt}(I) + 1}{3z_{opt}(I)} = \frac{4}{3} + \frac{1}{3z_{opt}(I)}$$

因为如果 $z_{opt}(I) = 1$,则 $z_{FFD}(I) = 1$,故不妨设 $z_{opt}(I) \ge 2$

因此
$$\frac{z_{FFD}(I)}{z_{opt}(I)} \le \frac{4}{3} + \frac{1}{6} = \frac{3}{2}$$

考虑实例 I: 物品集长度为 $\left\{\frac{C}{2}, \frac{C}{3}, \frac{C}{3}, \frac{C}{3}, \frac{C}{4}, \frac{C}{4}\right\}$, C 为箱长.

$$z_{opt}(I) = 2$$
, $z_{FFD}(I) = 3$ 说明 $\frac{3}{2}$ 是不可改进的. \square



比较 NF 算法、FF(BF) 算法、FFD 算法,它们的近似程度一个比一个好,但这并不是说 NF、FF(BF) 就失去了使用价值.

- 1、FF(BF)、FFD 算法都要将所有物品全部装好后,所有箱子才能一起运走,而NF 算法无此限制,很适合装箱场地小的情形;
- 2、FFD 算法要求所有物品全部到达后才开始装箱,而 NF、FF(BF) 算法在给某一物品装箱时,可以不知道下一个物品的长度如何,适合在线装箱.



存储罐注液问题

某化工厂有9个不同大小的存储罐,有一些已经装某液体.现新到一批液体化工原料需要存储,这些液体不能混合存储,它们分别是1200 m³ 苯,700 m³ 丁醇,1000 m³ 丙醇,450 m³ 苯乙醇和1200 m³ 四氢呋喃.下表列出每个存储罐的属性(单位: m³),问应如何将新到的液体原料装罐,才能使保留未用的存储罐个数最多?

存储罐编号	1	2	3	4	5	6	7	8	9
容量	500	400	400	600	600	900	800	800	800
当前内容	-	苯	-	-	-	-	四氢呋喃	-	-
体 积		100					300		



Solution:分别记苯、丁醇、丙醇、苯乙醇、四氢呋喃为第1,2,3,4,5种液体.显然,新到液体应尽可能装入已存有此种液体的罐中.

所以余下液体为: $900 \, m^3$ 苯, $700 \, m^3$ 丁醇, $1000 \, m^3$ 丙醇, $450 \, m^3$ 乙醇和 $700 \, m^3$ 四氢呋喃 . 剩余空罐为1,3,4,5,6,8,9 . 由于不允许混合,每种液体至少需要1个空罐 .

令
$$x_{ij} = \begin{cases} 1 & \text{\hat{x} i 种液体装入第} j \land f \text{\hat{x} i } \\ 0 & \text{否则} \end{cases}$$

记第j个空罐的容量为 c_j , j=1,3,4,5,6,8,9, 第i种剩余液体的体积为 l_i , i=1,2,3,4,5.

存储罐编号	1	2	3	4	5	6	7	8	9
容量	500	400	400	600	600	900	800	800	800
当前内容	-	苯	-	-	-	-	四氢呋喃	-	-
体 积		100					300		



整数规划模型:

min
$$z = \sum_{\substack{j=1 \ j \neq 2,7}}^{9} \sum_{i=1}^{5} x_{ij}$$

$$s.t. \sum_{\substack{j=1\\j\neq 2,7}}^{9} c_j x_{ij} \ge l_i \quad i = 1 \sim 5$$

$$\sum_{i=1}^{5} x_{ij} \le 1 \cdot j = 1, 3, 4, 5, 6, 8, 9$$

$$x_{ij} \in \{0,1\}$$
 $i = 1 \sim 5;$
 $j = 1, 3, 4, 5, 6, 8, 9$

$$\sum_{i=1}^{5} x_{ij} = 1$$
 表示第 j 个 空罐被使用

每种液体的体积不 能超过装这些液体 的罐子的总容量

每个罐子至多 装一种液体

将 l_i 、 c_j 代入,可用Lindo、Lingo 等软件求解.

当问题的数据很大时,IP 的计 算复杂性很高,可考虑采用近似 算法或启发式算法求解.

如利用 FFD 算法思想:对每 一种液体,将空罐按容积排成非 增序: 若需 k 个罐子,则装入具 有连贯序号的罐子, 使这k个空 罐中最大容积空罐序号最大.

800 600 600 500400

丙

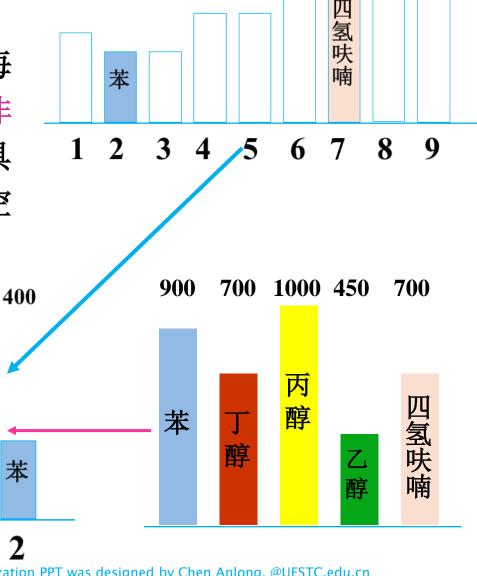
醇

丙

醇

800

四氢呋喃



四氢呋喃

醇

9

苯

500 400

400

600 600

900

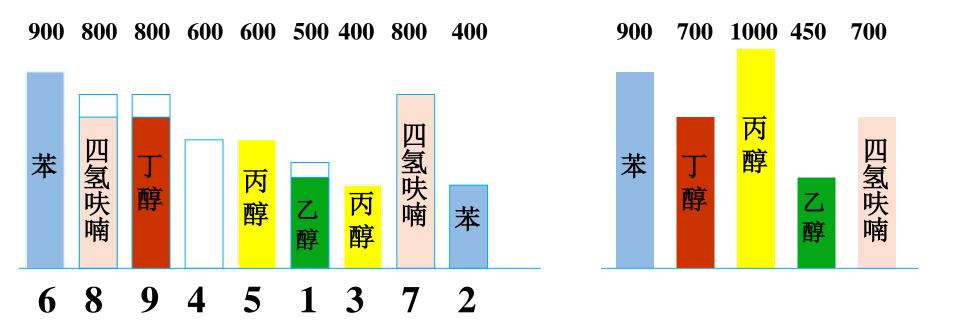
800

800



如果算法再细一点,只需要一个空罐的液体先装,效果会好一些。

后一种装法的空罐容积大,这是因为只需一个空罐的液体先装时,这部分装罐实现了最优.需要两个及以上空罐时,寻找最优算法的计算量就会变大.





本章结束