

Исследование модификаций метода VIKOR: интервальная и нечеткая версии

Ванчугов С.М., Гамов И.А.

СПбПУ, ИКНТ ВШ ПИ

2025

Выполнили студенты группы 5140903/40401:
Ванчугов С. М, Гамов И. А.

Руководитель:
Старший преподаватель В. А. Пархоменко

Актуальность и цель

- В задачах многокритериального принятия решений часто требования конфликтуют, нужна компромиссная стратегия.
- Классический VIKOR выдаёт компромиссное ранжирование, но требует точных числовых оценок.
- Цель: описать VIKOR, интервальную и нечеткую модификации, показать реализацию и иллюстративный пример.

Классический VIKOR – формула и логика

Даны альтернативы $A = \{A_1, \dots, A_m\}$, критерии $C = \{c_1, \dots, c_n\}$, оценки f_{ij} , веса w_j , $\sum_j w_j = 1$.

Идеальные / надирные:

$$\text{выгодный: } f_j^* = \max_i f_{ij}, \quad f_j^- = \min_i f_{ij},$$

$$\text{затратный: } f_j^* = \min_i f_{ij}, \quad f_j^- = \max_i f_{ij}.$$

Меры:

$$S_i = \sum_{j=1}^n w_j \frac{f_j^* - f_{ij}}{f_j^* - f_j^-}, \quad R_i = \max_j \left\{ w_j \frac{f_j^* - f_{ij}}{f_j^* - f_j^-} \right\}.$$

Компромисс:

$$Q_i = \nu \frac{S_i - S^*}{S^- - S^*} + (1 - \nu) \frac{R_i - R^*}{R^- - R^*}.$$

Области применимости и ограничения

- Подходит для инженерии, экологии, управления проектами, инвестиций.
- Ограничение: требует точечных оценок; чувствителен к неопределённости и заданию весов.
- Решение: расширения – интервальная и нечеткая (fuzzy) версии.

Суть интервальной модификации

- Оценки задаются интервалами $f_{ij} = [\underline{f}_{ij}, \bar{f}_{ij}]$.
- Идеальные/надирные точки – интервалы, построенные по компонентам (min/max нижних/верхних границ).
- Для каждого критерия формируют интервальный нормализованный разрыв $D_{ij} = [D_{ij}^{\text{low}}, D_{ij}^{\text{high}}]$ (пессимистичный / оптимистичный сценарии).
- Получают $S_i = [S_i^{\text{low}}, S_i^{\text{high}}]$, $R_i = [R_i^{\text{low}}, R_i^{\text{high}}]$, и интервальные Q_i .
- Ранжирование: часто по центрам интервалов или специальным правилам сравнения интервалов.

Интервальная версия VIKOR предложена в работе [1, 2].

Интервальная арифметика

- Интервал задаётся как $x = [\underline{x}, \bar{x}]$ – множество значений между границами.
- Базовые операции:

$$[a, b] + [c, d] = [a + c, b + d],$$

$$[a, b] - [c, d] = [a - d, b - c],$$

$$[a, b] \times [c, d] = [\min S, \max S], \quad S = \{ac, ad, bc, bd\}.$$

- Деление: $[a, b]/[c, d]$ определена, если $0 \notin [c, d]$; вычисляется как умножение на обратный интервал.

Интервальная арифметика используется в рамках интервального VIKOR по [1].

Формулы по интервальной модификации

Для выгодного критерия:

$$f_j^* = [\max_i \underline{f}_{ij}, \max_i \bar{f}_{ij}], \quad f_j^- = [\min_i \underline{f}_{ij}, \min_i \bar{f}_{ij}].$$

Нормализация:

$$D_{ij} = \left[\frac{f_j^{*(\text{low})} - \bar{f}_{ij}}{f_j^{*(\text{low})} - f_j^{-}(\text{high})}, \frac{f_j^{*(\text{high})} - \underline{f}_{ij}}{f_j^{*(\text{high})} - f_j^{-}(\text{low})} \right].$$

Агрегация:

$$S_i = [\sum_j w_j D_{ij}^{\text{low}}, \sum_j w_j D_{ij}^{\text{high}}], \quad R_i = [\max_j w_j D_{ij}^{\text{low}}, \max_j w_j D_{ij}^{\text{high}}].$$

Формулы нормализации и агрегации соответствуют интервальному VIKOR [1, 2].

Пример по интервальнойной модификации

Данные: 4 альтернативы, 3 критерия, матрица интервалов.

Результат:

- Интервальные Q_i (пример):
[0.000, 0.857], [0.243, 0.571], [1.000, 0.794], [0.000, 0.479].
- Ранжирование по центрам Q : A4 → A2 → A1 → A3.
- Интервальная форма показывает возможные пересечения и частичные порядки.

Пример приведён по мотивам вычислительной схемы интервального VIKOR [1].

Ключевые этапы реализации:

- ① Вход: матрица $(m, n, 2)$ с парами $[\underline{f}_{ij}, \bar{f}_{ij}]$.
- ② Вычисление f_j^* , f_j^- по нижним/верхним границам.
- ③ Для каждой пары вычисление D_{ij}^{low} и D_{ij}^{high} по формулам с соответствующими концами интервалов.
- ④ Агрегация – получаем интервальные S_i, R_i ; формируем интервальные Q_i .
- ⑤ Ранжирование – по центру интервала Q^{center} или правилам сравнения интервалов; применяем условия C_1, C_2 – acceptable advantage / stability.

Интервальная версия – реализация и выводы, ч.2

Результат работы алгоритма:

Таблица: Интервальные метрики S , R и Q для альтернатив

Альтернатива	S_i	R_i	Q_i	Q_i^{center}
A1	[0.300, 0.800]	[0.300, 0.320]	[0.000, 0.857]	0.429
A2	[0.480, 0.460]	[0.300, 0.300]	[0.243, 0.571]	0.407
A3	[0.640, 0.520]	[0.400, 0.400]	[1.000, 0.794]	0.897
A4	[0.120, 0.480]	[0.120, 0.240]	[0.000, 0.479]	0.239

Таблица: Ранжирование альтернатив по метрике Q

Ранжирование	Лучшая альтернатива
$A4 \rightarrow A2 \rightarrow A1 \rightarrow A3$	A4

Идея нечеткой модификации

- Оценки и/или веса задаются ТФН (треугольные нечеткие числа)
 $\tilde{x} = (x^L, x^M, x^U)$.
- Операции (максимум, сумма, умножение) выполняются покомпонентно.
- Получаем нечеткие $\tilde{S}_i, \tilde{R}_i, \tilde{Q}_i$; затем дефаззификация в скаляры (обычно центроид $(L + M + U)/3$).
- Особенno удобен при лингвистических оценках экспертов [5, 3, 4].

Арифметика неявных (нечетких) чисел

Для треугольных чисел выделяют следующие математические операции:

- Сумма треугольных чисел:

$$\sum_{i=1}^n \tilde{N}_i = (\sum_{i=1}^n l_i, \sum_{i=1}^n m_i, \sum_{i=1}^n h_i).$$

- Сумма треугольного числа и скаляра:

$$\tilde{N} \oplus K = (l + K, m + K, h + K).$$

- Вычитание: $\tilde{N}_1 \ominus \tilde{N}_2 = (l_1 - r_2, m_1 - m_2, r_1 - l_2)$.

- Вычитание скаляра: $\tilde{N} - K = (l - K, m - K, h - K)$.

- Умножение на скаляр: $K \times \tilde{N} = (K \times l, K \times m, K \times h)$, для $K \geq 0$

- Умножение: $\tilde{N}_1 \otimes \tilde{N}_2 = (l_1 \times l_2, m_1 \times m_2, h_1 \times h_2)$.

- Деление на скаляр: $\frac{\tilde{N}}{K} = (\frac{l}{K}, \frac{m}{K}, \frac{h}{K})$.

- Оператор MAX: $\max_i \tilde{N}_i = (\max_i l_i, \max_i m_i, \max_i h_i)$.

- Оператор MIN: $\min_i \tilde{N}_i = (\min_i l_i, \min_i m_i, \min_i h_i)$.

Формулы

Идеальные/надирные TFN (выгодный):

$$\tilde{f}_j^* = (\max_i f_{ij}^L, \max_i f_{ij}^M, \max_i f_{ij}^U).$$

Нормализация (по Opricovic [5]):

$$\tilde{d}_{ij} = \left(\frac{f_j^{*L} - f_{ij}^U}{f_j^{*U} - f_j^{-L}}, \frac{f_j^{*M} - f_{ij}^M}{f_j^{*M} - f_j^{-M}}, \frac{f_j^{*U} - f_{ij}^L}{f_j^{*L} - f_j^{-U}} \right).$$

Агрегация:

$$\tilde{S}_i = \sum_j \tilde{w}_j \otimes \tilde{d}_{ij}, \quad \tilde{R}_i = \max_j (\tilde{w}_j \otimes \tilde{d}_{ij}).$$

Дефазификация: $S_i = \text{Defuzz}(\tilde{S}_i)$, аналогично для R_i и Q_i [5, 3, 4].

Пример по нечеткой модификации

Данные: 4 альтернативы, 3 критерия, матрица нечетких чисел.

Результат:

- Нечеткие \tilde{Q}_j : $([0.086, 0.448, 1.000], [-0.042, 0.293, 0.715], [-0.394, 0.010, 0.510], [0.074, 0.446, 0.996])$.
- Ранжирование по среднему значению Q : $A3 \rightarrow A2 \rightarrow A4 \rightarrow A1$.
- Дефазифицированные значения Q_j (пример):
 $(0.495, 0.314, 0.034, 0.491)$
- Ранжирование по точным значениям: $A3 \rightarrow A2 \rightarrow A4 \rightarrow A1$.

Ключевые этапы реализации:

- ① Вход: матрица $(m, n, 3)$ с нечеткими числами $\tilde{f}_{ij} = (l, m, r)$.
- ② Вычисление f_j^* , f_j^- по значениям l, m, r .
- ③ Для каждой пары вычисление \tilde{D}_{ij} .
- ④ Агрегация – получаем нечеткие \tilde{S}_i , \tilde{R}_i ; формируем интервальные \tilde{Q}_i .
- ⑤ Ранжирование – по среднему значению Q^m ;
- ⑥ Дефазифицирование – сведение к скаляру: $Q = (l + 2m + r)/4$.
Ранжируем и применяем условия C_1 , C_2 – acceptable advantage / stability.

Результат работы алгоритма:

Таблица: Нечёткие метрики Q , S и R для альтернатив

Альтернатива	Q_i	S_i	R_i	Q_i^{crisp}
A1	[0.086, 0.448, 1.000]	[1.535, 2.184, 2.897]	[1.000, 1.000, 1.000]	0.495
A2	[-0.042, 0.293, 0.715]	[1.103, 1.661, 1.935]	[1.000, 1.000, 1.000]	0.314
A3	[-0.394, 0.010, 0.510]	[0.791, 1.420, 1.770]	[0.516, 0.607, 0.710]	0.034
A4	[0.074, 0.446, 0.996]	[1.727, 2.353, 2.885]	[0.871, 0.903, 1.000]	0.491

Ранжирование:

Таблица: Ранжирование альтернатив по fuzzy

Ранг	Core	Conf.	Crisp Q	Crisp S / R
1	A3	0	A3	A3 / A3
2	A2	1	A2	A2 / A4
3	A4	1	A4	A1 / A1
4	A1	1	A1	A4 / A2

Когда применять какую модификацию

- **Интервальная** – данные заданы диапазонами (measurement error, диапазон оценок) [2, 1].
- **Fuzzy** – экспертные лингвистические оценки, неоднозначные предпочтения, когда важна модель принадлежности [5].
- Практика: для быстрой оценки можно использовать центры интервалов / модальные значения TFN; для критичных решений – полные методы с дефазификацией и анализом пересечений.

Чувствительность и trade-off

- Параметр v управляет компромиссом между S и R ; важно показать чувствительность ранжирования по v .
- Уступка (trade-off): пересчёт весов через тр-коэффициенты позволяет моделировать альтернативные приоритеты критериев.
- Рекомендация: включить график чувствительности Q vs v и анализ пересечений интервалов / рангов TFN в приложении.

Сравнение модификаций — результаты ранжирования

Таблица: Результаты ранжирования

Альтернатива	Классический	Интервальный	Fuzzy
A1	5	5	5
A2	4	4	4
A3	1	1	2
A4	6	6	6
A5	3	3	1
A6	2	2	3

По этим результатам видно, что учёт неопределённости способен изменить порядок предпочтений (например, A5 поднимается с 3-го места в классическом/интервальном вариантах на 1-е в fuzzy).

Анализ результатов

- Основной эффект: введение неопределённости (интервалы/TFN) меняет ранжирование — иногда существенно.
- Интервальная версия даёт диапазоны значений и наглядно показывает пересечения — полезно при оценке риска/неопределённости.
- Fuzzy VIKOR лучше отражает лингвистические/субъективные оценки; дефазификация может «сжать» неопределённость и изменить ранги.
- Практическая рекомендация: при наличии лингвистических оценок применять fuzzy; при измеренных диапазонах — интервальную; всегда анализировать чувствительность по v и способу дефазификации.

Выводы

- Классический VIKOR хорош для точных данных; интервальная и fuzzy модификации расширяют применимость в условиях неопределённости.
- Интервальная VIKOR — для диапазонов/погрешностей; даёт интервальные Q_i ; и частичные порядки.
- Fuzzy VIKOR — для лингвистических/экспертных оценок; требует внимательного выбора метода дефазификации.
- Рекомендация: при ответственном принятии решений использовать полные расширенные алгоритмы и сопровождать их анализом чувствительности (v, дефазификация, сравнение интервалов).

Список источников |

-  Sayadi M. K., Heydari M., Shahanaghi K. Extension of VIKOR method for decision making problem with interval numbers // Applied Mathematical Modelling. 2009. Vol.33, No.5. P.2257–2262.
DOI: 10.1016/j.apm.2008.06.002
-  Chatterjee P., Chakraborty S. A comparative analysis of VIKOR method and its variants // Decision Science Letters. 2016. Vol.5, No.4. P.469–486.
DOI: 10.5267/j.dsl.2016.5.004
-  Liu P., Qin X. An Extended VIKOR Method for Decision Making Problem with Interval-Valued Linguistic Intuitionistic Fuzzy Numbers Based on Entropy // Informatica. 2017. Vol.28, No.4. P.665–685.
DOI: 10.15388/Informatica.2017.151

Список источников II

-  Wan S.-P. The extended VIKOR method for multi-attribute group decision making with triangular intuitionistic fuzzy numbers // Knowledge-Based Systems. 2013. Vol.52. P.65–77.
DOI: [10.1016/j.knosys.2013.06.019](https://doi.org/10.1016/j.knosys.2013.06.019)
-  Opricovic S. Fuzzy VIKOR with an application to water resources planning // Expert Systems with Applications. 2011. Vol.38, No.10. P.12983–12990.
DOI: [10.1016/j.eswa.2011.04.097](https://doi.org/10.1016/j.eswa.2011.04.097)