《计算机算法设计与分析》

第五章 动态规划

马丙鹏 2020年10月15日

第五章 动态规划

- 5.1 一般方法
- 5.2 多段图问题
- 5.3 每对结点之间的最短路径
- 5.4 最优二分检索树
- 5.5 0/1背包问题
- 5.6 可靠性设计
- 5.7 货郎担问题
- 5.8 流水线调度问题

■ 1. 问题的描述

- 产在多段图中求从s到t的一条最小成本的路径,可以看 作是在k-2个段作出某种决策的结果。
- \triangleright 第i次决策决定 V_{i+1} 中的哪个结点在这条路径上,这里 1≤i≤k-2;
- ▶最优性原理对多段图问题成立。

- 2. 向前处理策略求解
 - \square 设P(i,j)是一条从 V_i 中的结点j到汇点t的最小成本路径, COST(i, j)是这条路径的成本。

□向前递推式 Vi中的结点j到汇 点t的最小成本

Vi中的结点j到Vit 中的结点l成本

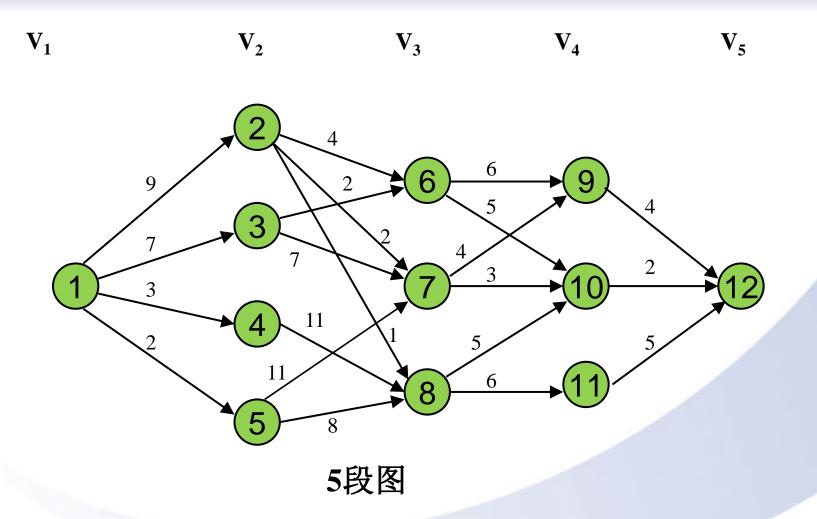
$$COST(i, j) = \min_{\substack{l \in v_{i+1} \\ (j,l) \in E}} \{c(j,l) + COST(i+1,l)\}$$

□ 递推过程

第k-1段

V_{i+1}中的结点l到 汇点t的最小成本

$$COST(k-1, j) = \begin{cases} c(j, t) & \langle j, t \rangle \in E \\ \infty & \end{cases}$$



$$COST(i, j) = \min_{\substack{l \in v_{i+1} \\ < j, l > \in E}} \{c(j, l) + COST(i+1, l)\}$$

第4段
$$COST(4, 9) = c(9, 12) = 4$$

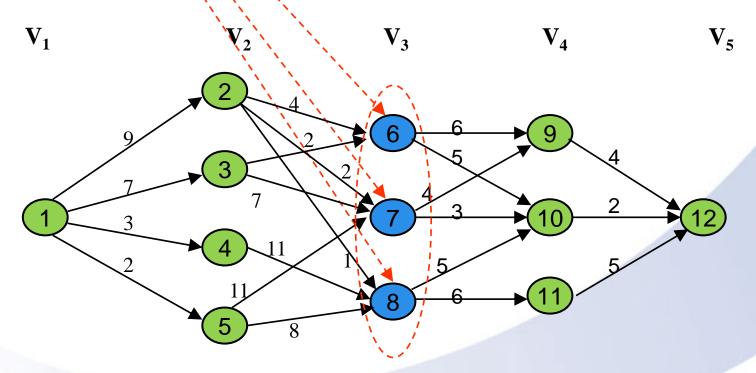
 $COST(4, 10) = c(10, 12) = 2$
 $COST(4, 11) = c(11, 12) = 5$
 V_1 V_2 V_3 V_4 V_5
 V_5 V_6 V_7 V_8 V_9 V_9

5段图

$$COST(i, j) = \min_{\substack{l \in V_{i+1} \\ < j, l > \in E}} \{c(j, l) + COST(i+1, l)\}$$

第3段
$$COST(3, 6) = min\{6+COST(4, 9), 5+COST(4, 10)\} = 7$$

 $COST(3, 7) = min\{4+COST(4, 9), 3+COST(4, 10)\} = 5$
 $COST(3, 8) = min\{5+COST(4, 10), 6+COST(4, 11)\} = 7$



5段图



$$COST(i, j) = \min_{\substack{l \in v_{i+1} \\ < j, l > \in E}} \{c(j, l) + COST(i+1, l)\}$$

第2段 $COST(2, 2) = min{4+COST(3, 6), 2+COST(3, 7), 1+COST(3, 8)} = 7$ COST(2, 3) = 9COST(2, 4) = 18COST(2, 5) = 15 V_1 V_3 V_4 V_5 8 5段图

$$COST(i, j) = \min_{\substack{l \in v_{i+1} \\ < j, l > \in E}} \{c(j, l) + COST(i+1, l)\}$$

第1段 $COST(1, 1) = min{9 + COST(2, 2), 7 + COST(2, 3),$ 3+COST(2,4), 2+COST(2,5)**= 16** $\mathbf{V_1}$ V_3 V_4 V_5 4 2 3 11 5 6 5段图

s到t的最小成本路径的成本 = 16



s到t的最小成本路径的成本 = 16



★ 最小路径的求取

记 D(i,j) = 每 - COST(i,j)的决策 即,使c(j,l) + COST(i+1,l)取得最小值的I值。

例:
$$D(3, 6) = 10$$
, $D(3, 7) = 10$, $D(3, 8) = 10$
 $D(2, 2) = 7$, $D(2, 3) = 6$, $D(2, 4) = 8$, $D(2, 5) = 8$
 $D(1, 1) = 2$

根据D(1,1)的决策值向后递推求取最小成本路径:

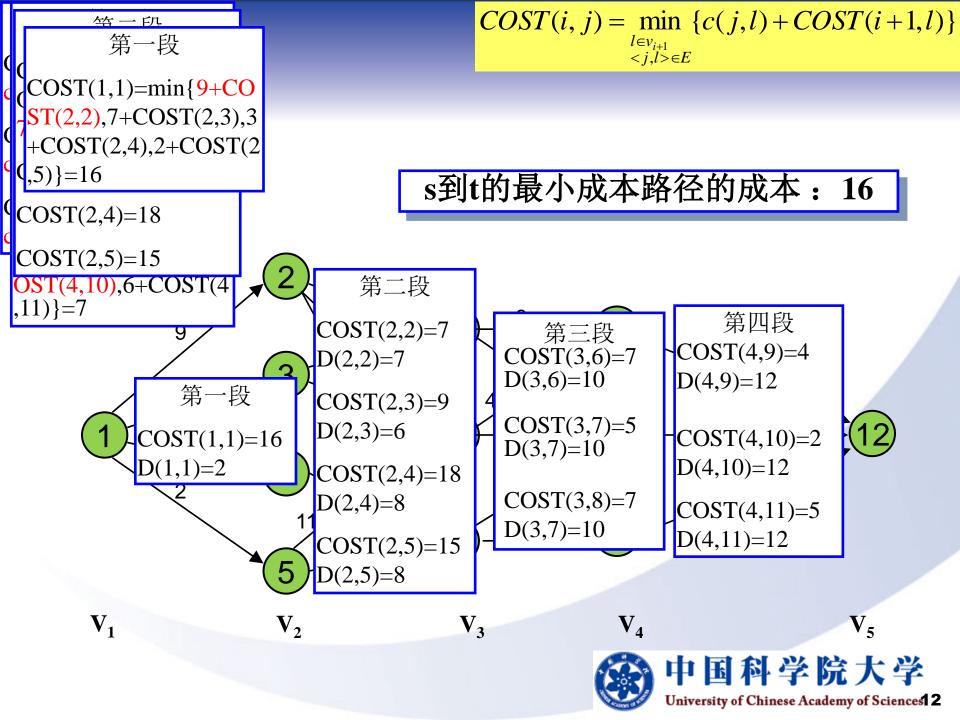
•
$$\mathbf{v}_2 = \mathbf{D}(1, 1) = 2$$

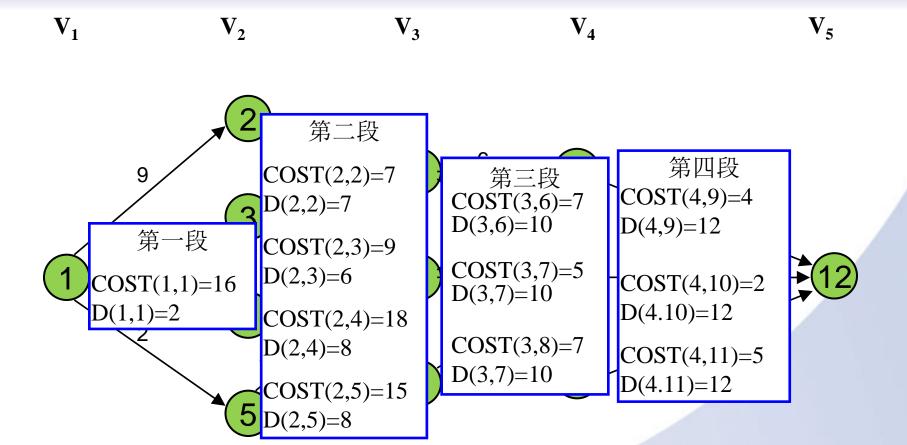
•
$$\mathbf{v_3} = \mathbf{D}(2, \mathbf{D}(1, 1)) = 7$$

$$\bullet$$
 $v_4 = D(3, D(2, D(1, 1))) = D(3, 7) = 10$

故由s到t的最小成本路径是: $1\rightarrow 2\rightarrow 7\rightarrow 10\rightarrow 12$







- 2. 向前处理策略求解
 - □算法描述
 - \triangleright 结点的编号规则 源点**s**编号为**1**,然后依次对**V**₂, **V**₃, ..., **V**_{k-1}中的结 点编号,汇点**t**编号为**n**。
 - ▶目的 使对COST和D的计算仅按n-1, n-2, ..., 1的次序计 算即可,
 - 无需考虑标示结点所在段的第一个下标。

算法5.1 多段图的向前处理算法

```
procedure FGRAPH(E, k, n, P)
```

//输入是按段的顺序给结点编号的,有n个结点的k段图。E是边

集,c(i,j)是边 $\langle i,j \rangle$ 的成本。P(1:k)带出最小成本路径//

real COST(n); integer D(n-1), P(k), r, j, k, n

 $COST(n) \leftarrow 0$

寻找第j个结点到终 点的最短路径

for j←n-1 to 1 by -1 do // 计算COST(j)//

设r是具有性质: $\langle j, r \rangle \in E$ 且使c(j, r) + COST(r)取最小值的结点

 $COST(j) \leftarrow c(j, r) + COST(r)$

D(j) ← r //记录决策值//

repeat

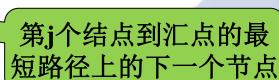
 $P(1)\leftarrow 1; P(k)\leftarrow n$

for j←2 to k-1 do //找路径上的第j个结点//

P(j) ←D(P(j-1)) //回溯求出该路径//

repeat

end FGRAPH



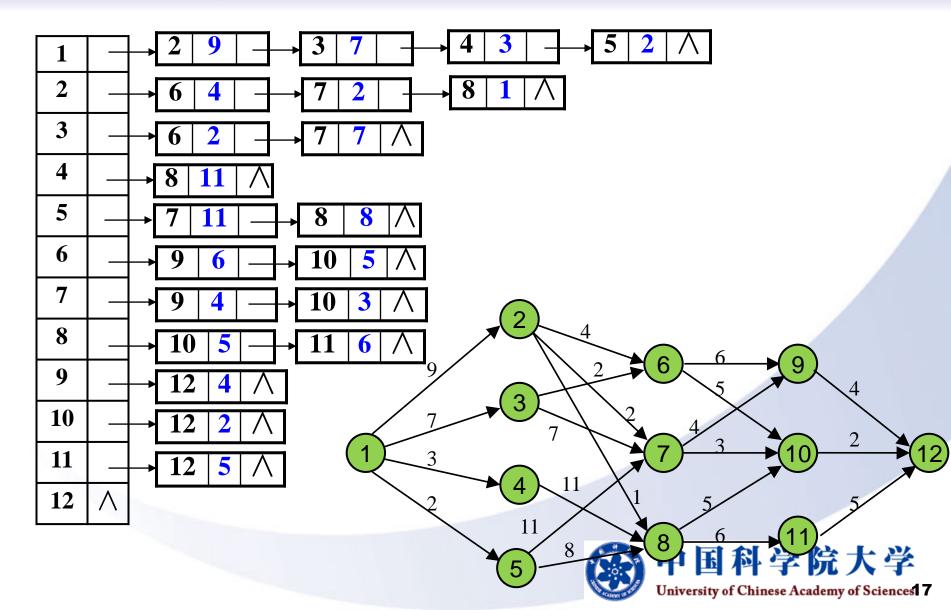
 $\Theta(n+e)$



- 2. 向前处理策略求解
 - □算法的时间复杂度
 - ▶若G采用邻接表表示,总计算时间为:

$$\Theta(n + e)$$

▶邻接表:邻接表是图的一种链式存储结构,对图中的每个顶点建立一个单链表,链表中的结点有3个域,分别存储顶点,边的成本和下一个结点的指针.



算法的执行过程

$$COST(12)=0;$$

{
$$COST(j)=min\{c(j,r)+COST(r)\};$$

$$D(j)=r;$$
 }

$$P(1)=1; P(k)=12;$$

for
$$j=2$$
 to 4 do $P(j)=D(P(j-1))$;

$$COST(8)=7$$
 $D(8)=10$

$$COST(7)=5$$
 $D(7)=10$

$$COST(6)=7$$
 $D(6)=10$

$$COST(5)=15$$
 $D(5)=8$

$$COST(4)=18$$
 $D(4)=8$

$$COST(3)=9$$
 $D(3)=6$

$$COST(2)=7$$
 $D(2)=7$

COST	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
	16	7	9	18	15	7	5	7	4	2	5	0

COST(1)=16

$$D(1)=2$$



- 3. 向后处理策略求解
 - □设BP(i, j)是一条从源点s到V_i中的结点j的最小成本路径,BCOST(i, j)是这条路径的成本。
 - □向后递推式

源点s到V_i中的结 点j的最小成本

源点s到V_{i-1}中的 结点l的最小成本

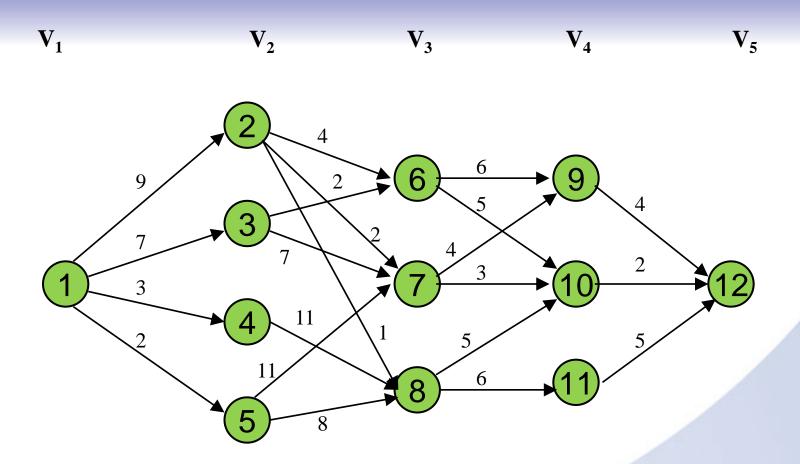
$$BCOST(i, j) = \min_{\substack{l \in v_{i-1} \\ (l, j) \in E}} \{BCOST(i-1, l) + c(l, j)\}$$

- □递推过程
 - ▶第2段

 V_{i-1} 中的结点I 到 V_{i+1} 中的结点J的成本

$$BCOST(2, j) = \begin{cases} c(1, j) & <1, j> \in E \\ \infty & \end{cases}$$





5段图



$$BCOST(i, j) = \min_{\substack{l \in v_{i-1} \\ (l, j) \in E}} \{BCOST(i-1, l) + c(l, j)\}$$

第2段 BCOST(2, 2) = 9BCOST(2, 3) = 7BCOST(2, 4) = 3BCOST(2, 5) = 2 V_1 V_5 V_3 8 5段图

> 中国科学院大学 University of Chinese Academy of Science 21

$$BCOST(i, j) = \min_{\substack{l \in v_{i-1} \\ (l, j) \in E}} \{BCOST(i-1, l) + c(l, j)\}$$

第3段 $BCOST(3, 6) = min\{BCOST(2, 2) + 4, BCOST(2, 3) + 2\} = 9$ $BCOST(3, 7) = min\{BCOST(2, 2) + 2, BCOST(2, 3) + 7,$ BCOST(2, 5)+11} = 11 $BCOST(3, 8) = min\{BCOST(2, 2)+1, BCOST(2, 4)+11,$ BCOST(2, 5)+8 = 10 V_1 $\mathbf{V}_{\mathbf{A}}$ V_5 8

5段图

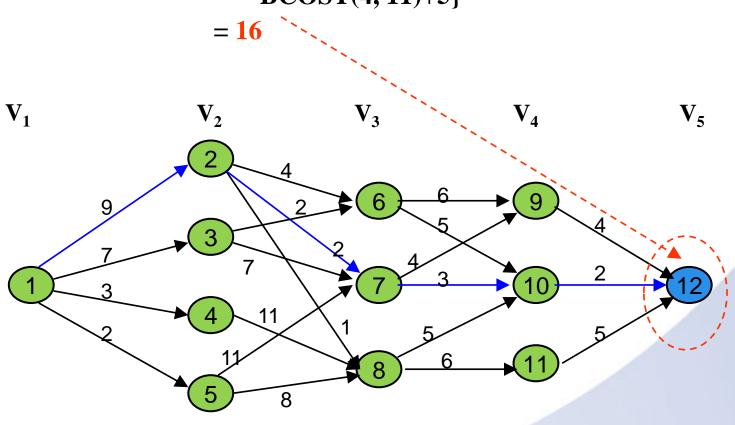


$$BCOST(i, j) = \min_{\substack{l \in v_{i-1} \\ (l, j) \in E}} \{BCOST(i-1, l) + c(l, j)\}$$



$$BCOST(i, j) = \min_{\substack{l \in v_{i-1} \\ (l, j) \in E}} \{BCOST(i-1, l) + c(l, j)\}$$

第5段 $BCOST(5, 12) = min\{BCOST(4, 9)+4, BCOST(4, 10)+2, BCOST(4, 11)+5\}$



s到t的最小成本路径的成本 = 16



s到t的最小成本路径的成本 = 16



★ 最小路径的求取

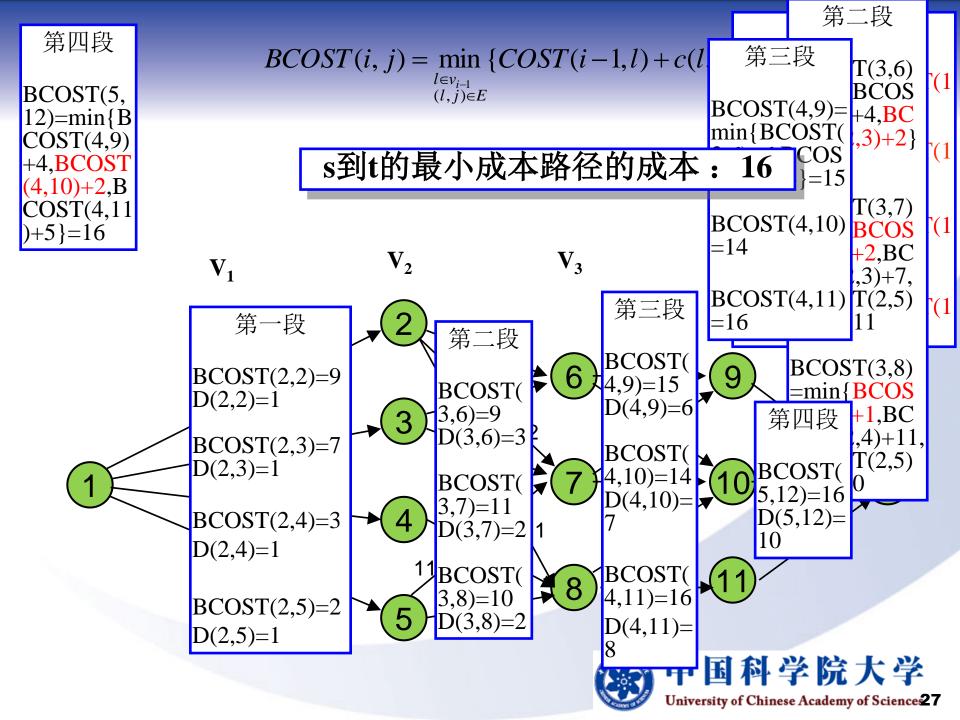
记 BD(i, j) = 每 - COST(i, j)的决策 即,使COST(i-1, l) + c(l, j)取得最小值的I值。

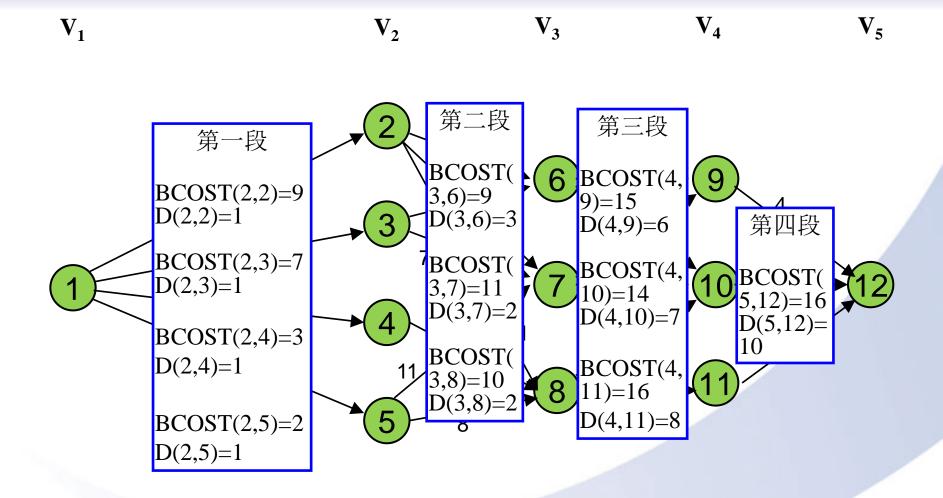
根据D(5,12)的决策值向前递推求取最小成本路径:

- \bullet v₄ = BD(5, 12) = 10
- $\mathbf{v_3} = \mathbf{BD}(4, \mathbf{BD}(5, 12)) = 7$
- \bullet $v_2 = BD(3, BD(4, BD(5, 12))) = BD(3, 7) = 2$

故由s到t的最小成本路径是: $1\rightarrow 2\rightarrow 7\rightarrow 10\rightarrow 12$







算法5.2 多段图的向后处理算法

```
procedure BGRAPH(E, k, n, P)
```

//输入是按段的顺序给结点编号的,有n个结点的k段图。E是边集,c(i, j)是边<i, j>的成本。P(1:k)带出最小成本路径// real BCOST(n); integer BD(n-1), P(k), r, j, k, n BCOST(1)←0

for j←2 to n do //计算BCOST(j)//
设r是具有<r, j>∈E且使BCOST(r)+ c(r, j)取最小值性质的结点 BCOST(j)← BCOST(r)+ c(r, j) BD(j)←r //记录决策值//

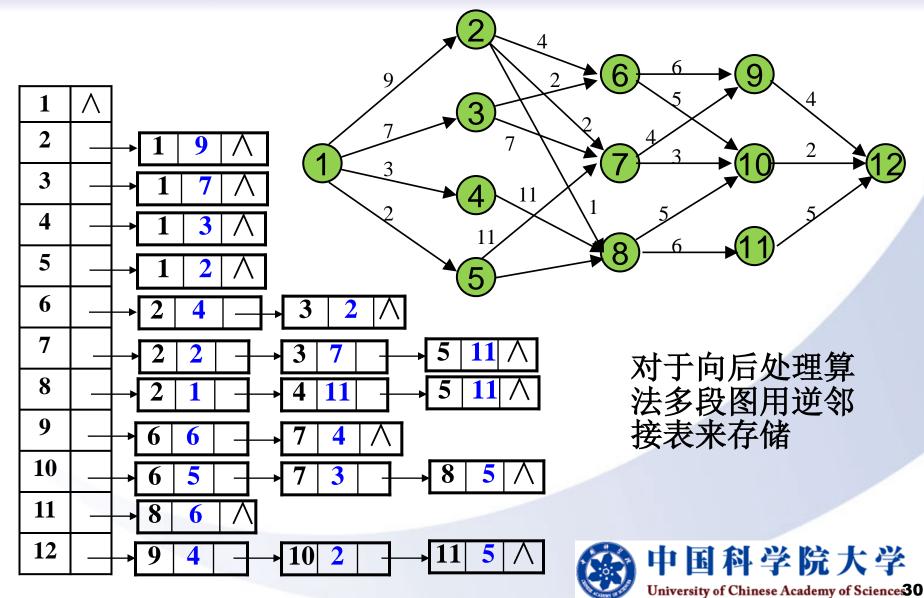
University of Chinese Academy of Sciences 29

repeat

$$P(1)\leftarrow 1; P(k)\leftarrow n$$

for j←k-1 to 2 by -1 do //找路径上的第j个结点//P(j) ←D(P(j+1)) //回溯求出该路径//repeat

end BGRAPH



第五章 动态规划

- 5.1 一般方法
- 5.2 多段图问题
- 5.3 每对结点之间的最短路径
- 5.4 最优二分检索树
- 5.5 0/1背包问题
- 5.6 可靠性设计
- 5.7 货郎担问题
- 5.8 流水线调度问题



■1. 问题描述

□设G=(V, E)是一个有n个结点的有向图, C是G的成本 邻接矩阵, C中元素有:

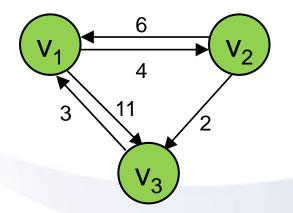
$$c(i,j) = \begin{cases} 0, & i = j \\ \dot{\upsilon} < i, j > \dot{n} \end{cases}$$

$$c(i,j) = \begin{cases} \dot{\upsilon} < i, j > \dot{n} \end{cases}$$

$$\dot{\upsilon} < i, j > \dot{n} \end{cases}$$

$$\dot{\upsilon} \neq j \perp \dot{\upsilon} \neq i, j \leq n$$

$$\dot{\upsilon} \neq j \perp \dot{\upsilon} \neq i, j \leq n$$

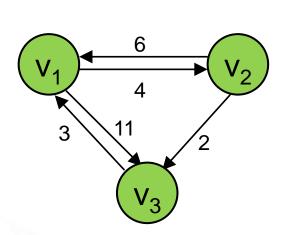


	1	2	3
1	0	4	11
2	6	0	2
3	3	∞	0



■1. 问题描述

- □每对结点之间的最短路径问题:
 - ▶求满足下述条件的矩阵A, A中的任一元素A(i, j) 代表结点i到结点j的最短路径长度。



	1	2	3			2		1
1	0	4	11	1	0	4	6	
2	6	0	2					
3	3	∞	0	3	3	7	0	

C: 成本邻接矩阵

A: 每对结点间最 短路径矩阵

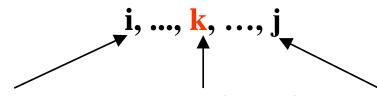
- ■1. 问题描述
 - □利用单源最短路径算法求解
 - ▶计算n个结点的单源最短路径。
 - ▶时间复杂度: O(n³)。
 - □利用动态规划策略求解
 - ▶将求解G中每对结点之间的最短路径问题转化成 一个多阶段决策过程。
 - ▶最优性原理对于该问题是否成立?
 - >决策什么?

■ 2. 动态规划求解策略

即证明最短路径具有最优性原理刻画的性质

□最优性原理对于每对结点之间的最短路径问题成立

对G的一条由i到j的最短路径(假设该路径中不包含环),设k是该路径上的一个中间结点:



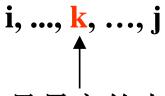
由i到k的最短路径 k是中间结点 由k到j的最短路径

则,由i到k和k到j的两条子路径将分别是由i到k和由k到j的最短路径。否则i,...,k,...,j也将不是由i到j的最短路径。

故,最优性原理对于该问题成立。



- 2. 动态规划求解策略
 - □多阶段决策过程 假设所有n个结点依次有从1到n的编号。 设k是由i到j的最短路径上编号最高的中间结点:



k是编号最高的中间结点

则由i到k的子路径上将不会有比编号k-1更大的结点;同理,由k到j的子路径上也将不会有比编号k-1更大的结点。

构造多阶段决策过程:对由i到j的最短路径,首先决策哪一个结点是该路径上具有最大编号的中间结点k,然后再去求取由i到k和由k到j的最短路径——其中应不包含比k-1还大的中间结点。

■ 2. 动态规划求解策略

□递推关系式

- ▶记A^k(i, j)表示从i到j并且不经过比k还大的结点的 最短路径长度。
- ➤A⁰(i, j): i至j的路径上中间不包含任何中间结点
- ▶A¹(i, j): i至j的路径上可以包含中间结点,但仅能 是结点1
- $A^2(i,j)$: i至j的路径上中间结点可以是结点1,2
- $\rightarrow A^3(i,j)$: i至j的路径上中间结点可以是结点1,2,3
- **>** ...



- 2. 动态规划求解策略
 - □递推关系式
 - \rightarrow Aⁿ(i, j): i至j的路径上中间可以包含结点1, 2, ..., n(i, j除外)
 - ▶因为所有结点的编号不会大于n,所以A(i, j) = Aⁿ(i, j), 即由i到j的最短路径不通过编号比n还大的结点。
 - \rightarrow 所有的A(i,j)构成结果矩阵A。

- 2. 动态规划求解策略
 - □递推关系式
 - ▶注:该路径可以经过结点n,也可以不经过结点n。
 - ✓若该路径不经过结点n,则

$$A^{\mathbf{n}}(\mathbf{i},\mathbf{j}) = A^{\mathbf{n}-\mathbf{1}}(\mathbf{i},\mathbf{j})$$

✓若该路径经过结点n,则

$$A^{n}(i, j) = A^{n-1}(i, n) + A^{n-1}(n, j)$$

▶故可得

$$A^{n}(i, j) = min\{A^{n-1}(i, j), A^{n-1}(i, n) + A^{n-1}(n, j)\}$$

不经过n结点

经过n结点



■ 2. 动态规划求解策略

□递推关系式

▶注:对任意的k, k≥1

$$A^{k}(i, j) = min\{A^{k-1}(i, j), A^{k-1}(i, k) + A^{k-1}(k, j)\}$$

不经过k结点

▶初值:

$$A^{0}(i, j) = C(i, j), 1 \le i \le n, 1 \le j \le n$$

▶递推计算:

$$A^{1}(i, j) = min\{A^{0}(i, j), A^{0}(i, 1) + A^{0}(1, j)\}$$

$$A^{2}(i, j) = min\{A^{1}(i, j), A^{1}(i, 2) + A^{1}(2, j)\}$$

• • •

$$A^{n}(i, j) = min\{A^{n-1}(i, j), A^{n-1}(i, n) + A^{n-1}(n, j)\}$$

= $A(i, j)$ 中国科学院大学

经过k结点

University of Chinese Academy of Sciences 40

```
算法5.3 每对结点之间的最短路径长度
  procedure ALL-PATHS(COST, A, n)
    //COST(n,n)是n结点图的成本邻接矩阵; A(i,j)是结点v.到v.的最短路
     径的成本; COST(i, i)=0, 1≤i≤n//
                                                          A^0(i, j)
    integer i, j, k, n; real COST(n, n), A(n, n)
    for i \leftarrow 1 to n do
        for j\leftarrow 1 to n do
           A(i, j) ←COST(i, j) //用COST(i, j)对A<sup>0</sup>赋初值//
        repeat
                                                  A^{1}(i, j), A^{2}(i, j), ..., A^{n}(i, j) = A(i, j)
    repeat
    for k \leftarrow 1 to n do
        for i \leftarrow 1 to n do
            for j←1 to n do
                      A(i, j) \leftarrow \min\{A(i, j), A(i, k) + A(k, j)\}
            repeat
        repeat
                                        A^{k}(i, j) = min\{A^{k-1}(i, j), A^{k-1}(i, k) + A^{k-1}(k, j)\}
    repeat
```

end ALL-PATHS

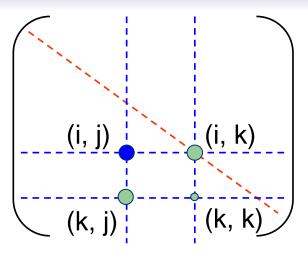


- 3. 算法描述
 - □程序正确性讨论
 - ▶∵ (1)在第k-1到第k次的迭代过程中, A的第k行、 第k列元素不变, 即

$$A^{k}(i, k) = A^{k-1}(i, k)$$

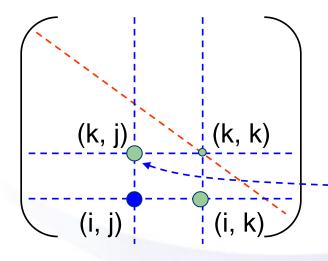
$$\mathbf{A}^{\mathbf{k}}(\mathbf{k},\mathbf{j}) = \mathbf{A}^{\mathbf{k}-1}(\mathbf{k},\mathbf{j})$$

▶(2)讨论k与i, j的关系,可知A(i, j), A(i, k)和A(k, j) 执行的先后次序



k>j且k>i,则有

$$A^{k}(i, j) \leftarrow min\{A^{k\text{-}1}(i, j), A^{k\text{-}1}(i, k) + A^{k\text{-}1}(k, j) \}$$

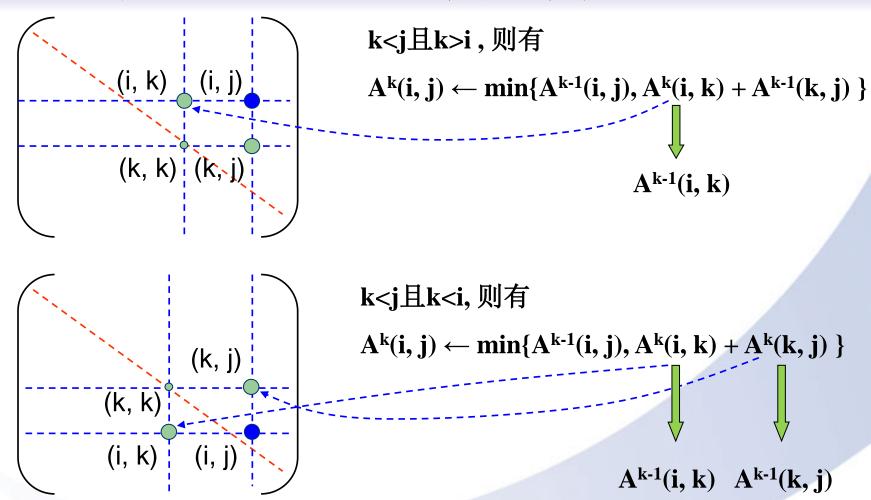


k>j且k<i,则有

$$A^{k}(i,j) \leftarrow min\{A^{k-1}(i,j), A^{k-1}(i,k) + A^{k}(k,j)\}$$







■ 3. 算法描述

□程序正确性讨论

$$A^{k}(i, j) \leftarrow \min\{A^{k-1}(i, j), A^{k}(i, k) + A^{k-1}(k, j)\}$$

$$A^{k}(i, j) \leftarrow \min\{A^{k-1}(i, j), A^{k-1}(i, k) + A^{k}(k, j)\}$$

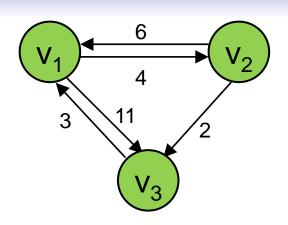
$$A^{k}(i, j) \leftarrow \min\{A^{k-1}(i, j), A^{k}(i, k) + A^{k}(k, j)\}$$

$$\equiv A^{k}(i, j) \leftarrow \min\{A^{k-1}(i, j), A^{k-1}(i, k) + A^{k-1}(k, j)\}$$

∴ 在算法的计算过程中取消了A的上标,并保证了每次计算的A^k(i, j)即为

$$\min\{A^{k-1}(i, j), A^{k-1}(i, k) + A^{k-1}(k, j)\}$$





	1	2	3
1	0	4	11
2	6	0	2
3	3	∞	0

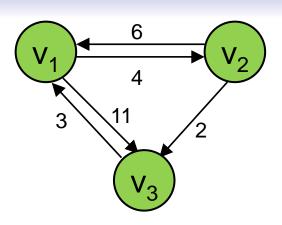
求图中所有结点间的最短路径矩阵A:

\mathbf{A}^{0}	1	2	3	A^1	1	2	3
1	0	4	11	1	0	4	11
2	6	0	11 2	2	6	0	2
3	3	∞	0	3		7	

A^2	1	2	3	A^3	1	2	3	
1	0	4	6	1	0	4	6	
2	6	0	6 2	2	5	4 0	2	
			0		3	7	0	

注: $A(i, j) = \infty$ 表明G中从i到j没有有向路径





算法的设计说明(1):

$$A^{k}(i, k) = A^{k-1}(i, k)$$

$$A^{k}(k, j) = A^{k-1}(k, j)$$

即:在由第k-1到第k 次的迭代过程中,A的第 k行、第k列元素保持不变

$$A^{1}(2, 3) = \min\{A^{0}(2, 3), A^{0}(2, 1) + A^{0}(1, 3)\}$$

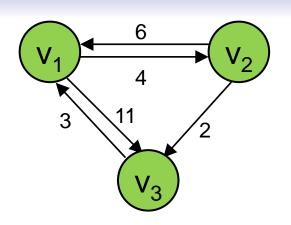
$$= \min\{2, 6 + 11\}$$

$$= 2$$

$$A^{1}(3, 2) = \min\{A^{0}(3, 2), A^{0}(3, 1) + A^{0}(1, 2)\}$$

$$= \min\{\infty, 3 + 4\}$$

=7



A ²	1	2	3
1	0	4	6
2	6	0	2
3	3	7	0

$$A^{2}(1, 3)=\min\{A^{1}(1, 3), A^{1}(1, 2)+A^{1}(2, 3)\}$$

$$=\min\{11, 4+2\}$$

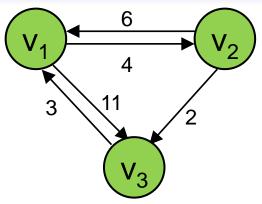
$$=6$$

$$A^{2}(3, 1)=\min\{A^{1}(3, 1), A^{1}(3, 2)+A^{1}(2, 1)\}$$

$$=\min\{3, 7+6\}$$

$$=3$$





6 V ₂				2	6	0 ∞	2	
V 1		4	2		3	3	∞	0
(3 //	11	/2					
		$\left(v_3\right)$						
A^3	1	2	3	$A^3(1)$	(1, 2)=m	in{ <i>A</i>	$A^{2}(1,$	2), A

$$A^{3}(1, 2)=\min\{A^{2}(1, 2), A^{2}(1, 3)+A^{2}(3, 2)\}$$

$$=\min\{4, 6+7\}$$

$$=4$$

$$A^{3}(2, 1)=\min\{A^{2}(2, 1), A^{2}(2, 3)+A^{2}(3, 1)\}$$

$$=\min\{6, 2+3\}$$

1 2 3 A¹

2 3

6 0

■ 3. 算法描述

```
□性能分析
```

```
▶计算时间 =Θ(n³)
```

➤ 注:该时间与A的值无关:

```
for k\leftarrow 1 to n do

for i\leftarrow 1 to n do

for j\leftarrow 1 to n do

A(i,j)\leftarrow min\{A(i,j),A(i,k)+A(k,j)\}
repeat
repeat
repeat
```



迭代n次

迭代n次

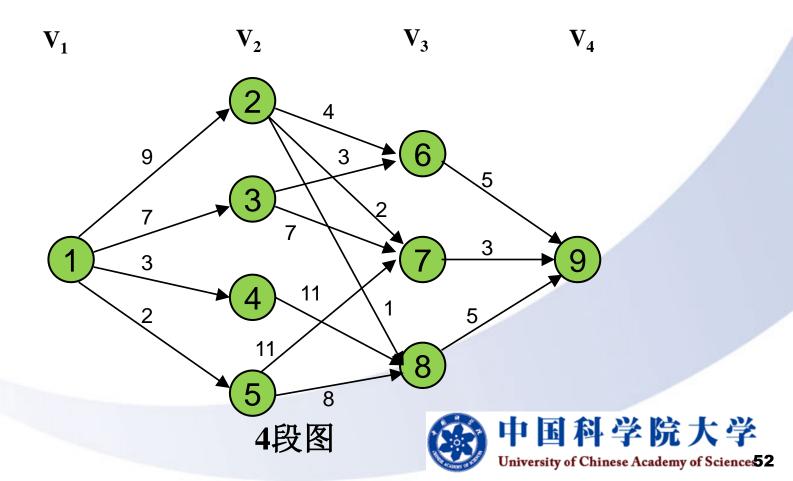
迭代n次

■ 3. 算法描述

- □∞的处理
 - An(i,j) ≤ (n-1)*M。
 - ➤因此,对于成本邻接矩阵中的∞用一个大于(n-1)*M的值代替。
 - \triangleright 如果在算法结束时,A(i,j)>(n-1)*M,则表明G中没有由i到j的有向路径。

作业-课后练习13

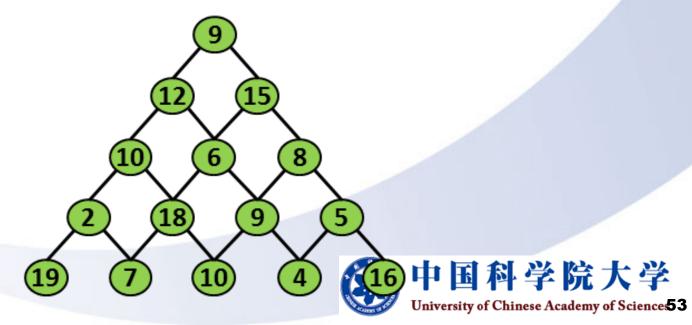
- ■问题描述
 - □用向前递推方法求解下面的四段图问题。



作业-课后练习14

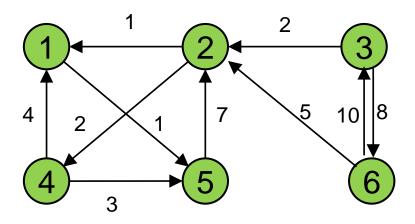
■问题描述

- □给定一个树塔,如下图所示。在此树塔中,从顶部出发,可以选择向左走还是向右走,一直走到最低层。请找出一条路径,使得路径上的数值和最大,并给出该数值和。(15分)
- □2014年本课程的考试试题



作业-课后练习15

- ■问题描述
 - □求下面两个图里面每对结点之间的最短路径



End

