

量子光学优化算法*

王金叶, 马良, 刘勇
(上海理工大学管理学院, 上海 200093)

摘要: 通过分析光学优化算法的特性, 将光学优化算法中每个光源点都用量子空间中的一个粒子来描述, 利用群体智慧的聚集性, 建立了光学优化算法的量子势能场模型, 并根据势能场模型的群体自组织性和协同性等特点提出了量子光学优化算法。通过对多个经典测试函数仿真分析, 得出量子光学优化算法在量子力学收敛理论下比光学优化算法控制参数少, 设置简单, 优化性能更好, 收敛速度更快, 优化了算法的收敛精度和速度。

关键词: 量子力学; 光学优化算法; 量子势能场; 仿真分析; 优化性能

中图分类号: TP310.6 **文献标志码:** A **文章编号:** 1001-3695(2018)03-0654-04

doi: 10.3969/j.issn.1001-3695.2018.03.003

Quantum-behaved optics inspired optimization

Wang Jinye, Ma Liang, Liu Yong
(Business School, University of Shanghai for Science & Technology, Shanghai 200093, China)

Abstract: By analyzing the character of optics optimization algorithm, this paper described every light point in the algorithm as a particle in the quantum space and found the quantum potential field model with the aggregation of swarm intelligence. Because of the points of self-organize and cooperation, this paper raised the quantum-behaved optics algorithm. Using several functions to analyze, the results show that the algorithm with the theory of quantum mechanics has fewer control parameters and simpler setup, and it has better performance and faster convergent speed than OIO algorithms.

Key words: quantum mechanics; optics inspired optimization (OIO); quantum potential energy field; simulation analysis; performance of optimization

0 引言

光学优化算法(optics inspired optimization, OIO)源于物理光学凸、凹面镜成像原理的优化算法^[1], 由Kashan于2015年提出。其原理是把优化函数看做反射镜面, 将函数的凸部分看做凸面镜, 函数的凹部分看做凹面镜, 每一个初始解则相当于一个初始光源点。每一个光源点的光线经函数镜面反射后, 由反射面凸凹不平的性质, 可得到正立或倒立的缩小的像, 这一系列像点即可作为下一次寻优的初始光源点^[2]。这种迭代模式在寻优的过程中可同时任务进行探究, 最终求得问题的最优解。与遗传算法^[3]、粒子群算法^[4]以及NS-GA II算法相比, 光学优化算法在处理优化问题上具有高度收敛精度与优势。

与其他智能算法一样, 由于初始解的不确定性, OIO算法存在易陷入局部最优、早熟收敛和后期收敛较慢等问题^[5]。为克服这些缺陷, 提高OIO算法中光源点的随机性和算法的全局搜索能力, 受量子粒子群算法的启发, 本文将OIO算法中每个光源点都用量子空间中的一个粒子来描述, 以体现光源点的不确定性, 并根据群体智慧的聚集性, 建立量子势能场模型, 然后根据群体自组织性和协同性等特点提出了QOIO(quantum-behaved optics inspired optimization)算法。QOIO算法控制参数少, 设置简单, 搜索能力强, 具有较强的全局搜索能力。通

过将QOIO算法对经典函数^[6]的仿真分析, 得出QOIO算法明显优于OIO算法。

1 QOIO模型的建立

1.1 从OIO到QOIO

文献[5, 7, 8]主要对光学算法的模型推导进行分析。在定义域内, 随机选取初始光源点 $O_j^t = [o_{j1}^t, o_{j2}^t, \dots, o_{jm}^t]$, 确定光源点的位置与高度, 并在定义域内随机选取一变量 F_{ik}^t , 但 $i_k \neq j$ 时 $F_{ik}^t \neq O_j^t$, 假设 F_{ik}^t 是镜面顶点坐标。如果 $f(O_j^t) < f(F_{ik}^t)$, 则将对应的函数段看做凸面函数模型; 如果 $f(O_j^t) > f(F_{ik}^t)$, 则将对应的镜面函数段看做是凹面函数模型。

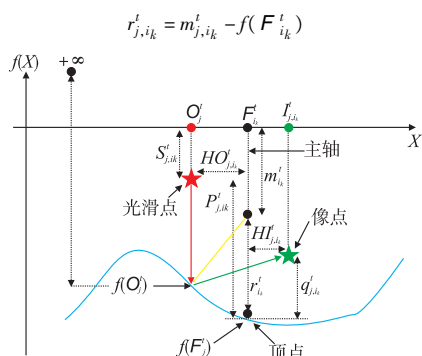
一维空间中, 假设第 j 光源点前面的镜子函数是凹面函数, 而该光源点的函数位置 $s_{j,ik}^t$ 是集合 $U[f(O_j^t), f(O_j^t) + d_\infty]$ 中的随机数(d_∞ 是一无穷大的数)。运算初始时, 设 $d_\infty = \max_{j=1, \dots, NO} \{f(O_j^t)\} + 1$ 。光学算法中每矫正一次球面偏差, 便更新一次 d_∞ 。由 $p_{j,ik}^t$ 的定义可得

$$p_{j,ik}^t = s_{j,ik}^t - f(F_{ik}^t) \quad (1)$$

其中: m_{ik}^t 为曲面函数圆心到 X 轴的距离。凹面函数成像原理如图1所示。由图1可得, m_{ik}^t 也是 $U[f(O_j^t), f(O_j^t) + d_\infty]$ 中的随机数。由 $r_{j,ik}^t$ 的定义得

收稿日期: 2016-12-03; **修回日期:** 2017-01-17 **基金项目:** 国家自然科学基金资助项目(71401106); 国家教育部人文社科规划基金项目(16YJA630037); 上海市高原学科建设项目; 上海高校青年教师培养计划资助项目(ZZsl15018); 上海理工大学博士科研启动经费项目(1D-15-303-005)

作者简介: 王金叶(1991-), 女, 硕士, 主要研究方向为系统工程、智能优化(Jinye_w@163.com); 马良(1964-), 男, 教授, 博导, 博士, 主要研究方向为系统工程、智能优化; 刘勇(1982-), 男, 讲师, 博士(后), 主要研究方向为智能优化、系统工程。



当光源点前的函数为凸函数时,第 j 个光源点的位置 s_{j,i_k}^t 是 $U[f(\mathbf{F}_{i_k}^t), f(\mathbf{F}_{i_k}^t) + d_\infty]$ 中的随机生成数。与凹面镜类似,由式(1)得出 p_{j,i_k}^t , 曲率圆心距 $m_{i_k}^t$ 是 $U[f(\mathbf{O}_j^t) - d_\infty, f(\mathbf{O}_j^t)]$ 内随机生成数, r'_{j,i_k} 可由式(2)得出。与凹面函数不同的是, r'_{j,i_k} 是一负值^[5]。已知 p_{j,i_k}^t 和 r'_{j,i_k} , 由镜面函数公式得出 q_{j,i_k}^t :

e)计算粒子当前适应值,并与前一次迭代适应度值作比较,若小于,则根据光源点的位置更新为粒子当前最优位置,即若 $f(\mathbf{x}_j^{t+1}) < f(\mathbf{l}_j^t)$, $\mathbf{l}_j^{t+1} = \mathbf{x}_j^{t+1}$ 。

f)将全局最优解 \mathbf{l}_j^t 中的 c 个变量对应赋值于 \mathbf{U}_j^t 中,若 $f(\mathbf{U}_j^t) < f(\mathbf{O}_j^t)$,则将第 j 个光源点用 \mathbf{U}_j^t 代替;若 $f(\mathbf{U}_j^t) < f(\mathbf{G})$,则 $\mathbf{G} = \mathbf{U}_j^t$;若 $k = K$ 不成立,则重复 b) ~ f)。

g)若停止条件满足,则 \mathbf{G} 即为所求最优解。

2 仿真实验

本文选择了 10 个经典测试^[16,17]函数来验证 QOIO 算法的有效性。表 1 给出了测试函数的定义、搜索空间和理论最优解。

表 1 经典测试函数

函数名称	公式	取值范围	最小值
Schwefel 2.22	$\sum_{i=1}^n x_i + \prod_{i=1}^n x_i $	$[-10, 10]^n$	0
Rosenbrock	$\sum_{i=1}^{n-1} (100(x_{i+1} - x_i^2)^2 + (x_i - 1)^2)$	$[-30, 30]^n$	0
Step	$\sum_{i=1}^n (\lfloor x_i + 0.5 \rfloor)^2$	$[-100, 100]^n$	0
Quartic	$\sum_{i=1}^n ix_i^4 + \text{random}(0, 1)$	$[-1.28, 1.28]^n$	0
Rastrigin	$\sum_{i=1}^n (x_i^2 - 10 \cos(2\pi x_i) + 10)$	$[-5.12, 5.12]^n$	0
Griewank	$\frac{1}{4000} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \prod_{i=1}^n \cos(\frac{x_i}{l}) + 1$	$[-600, 600]^n$	0
Penalized	$\frac{\pi}{n} 10 \sin^2(\pi y_1) + \sum_{i=1}^{n-1} (y_i - 1)^2 [1 + 10 \sin^2(\pi y_{i+1})] + (y_n - 1)^2 + \sum_i u(x_i, 10, 100, 4), y_i = 1 + \frac{1}{4}(x_i + 1)$ $u(x_i, a, k, m) = \begin{cases} k(x_i - a)^m & x_i > a \\ 0 & -a \leq x_i \leq a \\ k(-x_i - a)^m & x_i < -a \end{cases}$	$[-50, 50]^n$	0
Six-hump camel-back	$4x_1^2 - 2.1x_1^4 + \frac{1}{3}x_1^6 + x_1x_2 - 4x_2^2 + 4x_2^4$	$[-5, 5]^n$	-1.031 628 5
Branin	$(x_2 - \frac{5.1}{4\pi^2}x_1^2 + \frac{5}{\pi}x_1 - 6) + 10(1 - \frac{1}{8\pi})\cos(x_1) + 10$	$[-5, 10] \times [0, 15]$	0.398
Goldstein-price	$[1 + (x_1 + x_2 + 1)^2(19 - 14x_1 + 3x_1^2 - 14x_2 + 6x_1x_2 + 3x_2^2)] \times [30 + (2x_1 - 3x_2)^2 \times (18 - 32x_1 + 12x_1^2 + 48x_2 - 36x_1x_2 + 27x_2^2)]$	$[-2, 2]^n$	3

算法求解相关的参数设置如下:光源点数为 40 个,最少镜面函数为 0,最多镜面数为 40 个。为了验证算法的收敛效果,对

表 1 中的函数选取不同的维度运行 5 000 次,寻求各函数最小值及取值点。统计最优解、平均解及标准差,结果如表 2 所示。

表 2 仿真结果

函数名称	维数	OIO 算法			QOIO 算法		
		平均值	方差	最好值	平均值	方差	最好值
Schwefel 2.22	10	7.9455e-004	1.5478e-007	4.5287e-004	5.0343e-028	1.7666e-054	4.4231e-033
	30	3.801 6	0.739 7	2.660 8	1.6238e-024	1.3081e-047	1.3360e-026
	50	24.978 8	13.279 1	20.674 6	7.5807e-022	4.0518e-042	3.4589e-026
Rosenbrock	10	2.453 3	14.364 0	1.0431e-004	5.4246e-004	7.5137e-007	1.7666e-005
	30	5.758 0	1.4627e+002	0.001 0	0.008 9	1.9787e-004	4.2715e-005
	50	4.874 2	2.3499e+002	0.005 1	0.016 8	3.6203e-004	3.5277e-005
Step	10	3.3560e-005	2.0038e-009	2.9577e-006	5.0890e-010	2.9394e-019	4.8348e-011
	30	1.2329e+002	1.7544e+003	80.004 3	1.7233e-005	9.2673e-010	1.0076e-007
	50	3.1975e+003	5.1202e+005	2.4755e+003	1.5376e-004	4.6594e-008	1.7144e-007
Quartic	10	9.8962e-004	3.5008e-006	4.6802e-007	0	0	0
	30	15.446 2	3.016 4	12.736 9	0	0	0
	50	63.235 3	18.788 4	55.990 1	0	0	0
Rastrigin	10	0.793 9	0.651 7	0.001 1	0	0	0
	30	44.215 0	18.704 1	37.938 7	0	0	0
	50	1.7211e+002	5.4291e+002	1.3285e+002	0	0	0
Griewank	10	0.042 8	6.0622e-004	2.5254e-004	0	0	0
	30	1.990 7	0.524 1	1.193 8	0	0	0
	50	28.123 1	1.1467e+002	16.895 2	0	0	0
Penalized	10	3.4420e-006	7.0355e-011	6.1711e-008	2.0111e-010	4.5282e-020	2.7953e-011
	30	7.917 5	8.947 0	4.389 1	9.5940e-006	1.0423e-010	1.0177e-008
	50	4.0636e+005	2.8095e+011	6.3912e+003	4.1617e-006	1.7526e-011	2.2626e-007
Six-hump camel-back	2	-1.031 6	2.1912e-032	-1.031 6	-1.031 6	0	-1.031 6
Branin	2	0.397 8	0	0.397 8	0.397 8	0	0.397 8
Goldstein-price	2	3	2.1036e-030	3	3	4.3825e-032	3

实验结果可以看出, QOIO 算法对于经典函数的优化结果精度明显优于 OIO 算法。对于 Quartic、Rastrigin、Griewank、Six-hump camel-back、Branin、Goldstein_price 函数, QOIO 算法都可以收敛到全局最优解。

为进一步验证 QOIO 算法的收敛速度和精度的优越性, 用表 1 中的基准函数, 在操作环境为 Intel i3 处理器, Windows 7 操作系统, MATLAB 2010 软件下, 设置相同随机数以产生相同初始种群及相同的随机数序列, 将 QOIO 与 OIO 算法进行对比测试, 设定种群规模为 40, 迭代次数为 10 000, 结果如图 2 ~ 11 所示。其中, 纵轴是寻找到的最小值, 取以 10 为底的对数; 横轴是迭代次数。

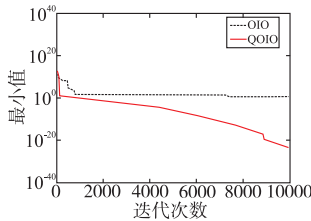


图2 Schwefel 2.22函数($D=30$)迭代最优值变化曲线

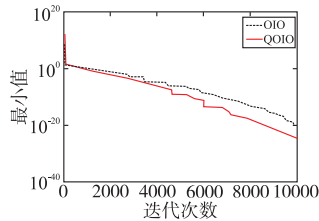


图3 Rosenbrock函数($D=30$)迭代最优值变化曲线

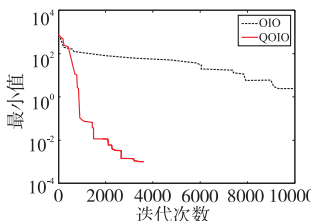


图4 Step函数($D=30$)迭代最优值变化曲线

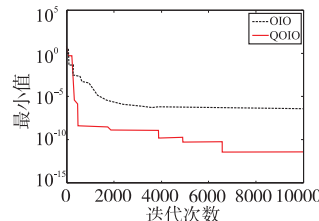


图5 Quartic函数($D=30$)迭代最优值变化曲线

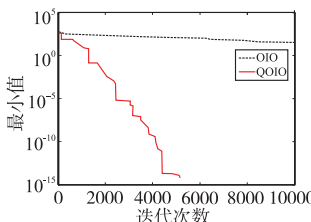


图6 Rastrigin函数($D=30$)迭代最优值变化曲线

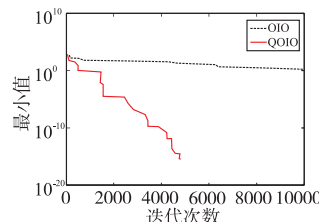


图7 Griewank函数($D=30$)迭代最优值变化曲线

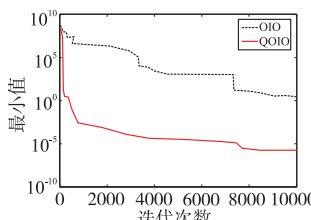


图8 Penalized函数($D=30$)迭代最优值变化曲线

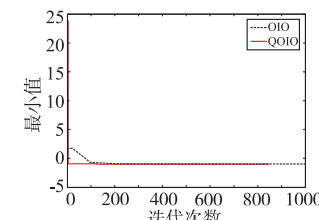


图9 Six-hump camel-back函数($D=2$)迭代最优值变化曲线

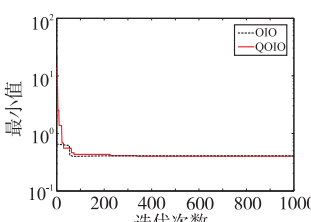


图10 Branin函数($D=2$)迭代最优值变化曲线

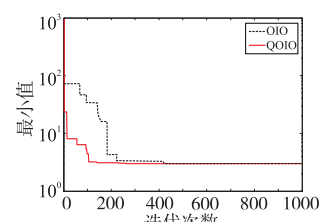


图11 Goldstein-price函数($D=2$)迭代最优值变化曲线

从图 2 ~ 11 中每次迭代最优值变化的曲线可以看出, QOIO 算法的收敛速度明显快于 OIO 算法; 图 4、6、7 中可以看出, OIO 算法很快即可收敛到最优解。相比于 OIO 算法的精度不高、易发生早熟和停滞现象, QOIO 算法则克服了这些缺点, 以

新的解的更新方式建立了全局搜索与局部搜索之间更为有效的平衡机制, 加快了算法的收敛速度, 使算法更易收敛于全局最优解, 优化了算法的收敛精度和速度。

3 结束语

针对 OIO 算法在求解函数优化问题时收敛速度慢、收敛精度低等问题, QOIO 算法借鉴了量子力学原理, 改进了了解的更新方式; QOIO 算法控制参数少, 设置简单, 搜索能力强, 具有较强的全局搜索能力, 提高了算法的优化性能。经典测试函数通过设置不同的值得到多组非劣解表明, QOIO 算法增强了 OIO 算法的稳定性, 提高了收敛速度和收敛精度, 均表明了 QOIO 算法的有效性和实用性。

今后研究中, 将 QOIO 算法进一步应用到多目标模型的求解中, 并结合实际应用对算法进行深入的讨论。

参考文献:

- [1] Formato R A. Central force optimization: a new deterministic gradient-like optimization metaheuristic[J]. *Opsearch*, 2009, 46(1): 25-51.
- [2] Kashan A H. A new metaheuristic for optimization: optics inspired optimization (OIO) [J]. *Computers & Operations Research*, 2015, 55(3): 99-125.
- [3] 边霞, 米良. 遗传算法理论及其应用研究进展[J]. *计算机应用研究*, 2010, 27(7): 2425-2429, 2434.
- [4] 周驰, 高海兵, 高亮, 等. 粒子群优化算法[J]. *计算机应用研究*, 2003, 20(12): 7-11.
- [5] Kashan A H. An effective algorithm for constrained optimization based on optics inspired optimization (OIO) [J]. *Computer-Aided Design*, 2015, 63(6): 52-71.
- [6] 王凌. 量子进化算法研究进展[J]. *控制与决策*, 2008, 23(12): 1321-1326.
- [7] Konkar R. Analysing spherical aberration in concave mirrors[J]. *Resonance Journal of Science Education*, 2012, 17(8): 779-790.
- [8] 郭秀芝, 高丽丽. 凹面镜成像规律的讨论[J]. *大学物理实验*, 2003, 16(3): 36-37.
- [9] 方伟, 孙俊, 谢振平, 等. 量子粒子群优化算法的收敛性分析及控制参数研究[J]. *物理学报*, 2010, 59(6): 3686-3694.
- [10] Tang Wenling, Tian Guihua. Solving ground eigenvalue and eigenfunction of spheroidal wave equation at low frequency by supersymmetric quantum mechanics method[J]. *Chinese Physics B*, 2011, 20(1): 121-127.
- [11] Lalwani P, Banka H, Kumar C. CRWO: clustering and routing in wireless sensor networks using optics inspired optimization[J]. *Peer-to-Peer Networking and Applications*, 2017, 10(3): 453-471.
- [12] Xu Suhui, Mu Xiaodong, Chai Dong, et al. Multi-objective quantum-behaved particle swarm optimization algorithm with double-potential well and share-learning[J]. *Optik-International Journal for Light and Electron Optics*, 2016, 127(12): 4921-4927.
- [13] 杜卫林, 李斌, 田宇. 量子退火算法研究进展[J]. *计算机研究与发展*, 2008, 45(9): 1501-1508.
- [14] 张毅, 卢凯, 高颖慧. 量子算法与量子衍生算法[J]. *计算机学报*, 2013, 36(9): 1835-1842.
- [15] 吕强, 陈如清, 俞金寿. 量子连续粒子群优化算法及其应用[J]. *系统工程理论与实践*, 2008, 28(5): 122-130.
- [16] Karaboga D, Basturk B. A powerful and efficient algorithm for numerical function optimization: artificial bee colony (ABC) algorithm[J]. *Journal of Global Optimization*, 2007, 39(3): 459-171.
- [17] Kashan A H. League championship algorithm (LCA): an algorithm for global optimization inspired by sport championships[J]. *Applied Soft Computing*, 2014, 16(3): 171-200.