Branch and Bound e Backtracking

Lucas Fonseca Saliba — Lucas Santiago de Oliveira

Novembro de 2021

Sumário

1	Branch and Bound				
	1.1	Conceito	3		
	1.2	Quando usar	3		
	1.3	Exemplo	4		
2	Backtracking				
	2.1	Conceito	9		
3	Quando usar				
	3.1	Exemplo	10		
	3.2	Exemplo de algoritmo:	11		
4	Rel	ação entre Branch and Bound e Backtracking	14		
5	Relação com a Abordagem Gulosa				
	5.1	Conceito	14		
	5.2	Exemplo de código	14		
	5.3	Complexidade	15		

6	Relação com Programação Dinâmica				
	6.1	Conceito	15		
	6.2	Exemplo de código	15		
	6.3	$Complexidade \dots \dots$	16		
7	Relação com Divisão e Conquista				
	7.1	Conceito	17		
	7.2	Exemplo de algoritmo	18		
	7.3	Complexidade	20		

Resumo

Para começar falando sobre os algoritmos de otimização de problemas, começarei falando sobre o que é um problema linear na programação. Se considerarmos que exista um problema X que leva Y de tempo para ser resolvido e que Y cresce diretamente proporcinal ao crescimento de X, então temos um problema linear. A ideia de todos os algoritmos que serão citados nesse documento é fazer Y crescer mais lentamente. Dessa forma, se o problema X dobrar de tamanho Y não dobrará de tamanho junto.

1 Branch and Bound

1.1 Conceito

Branch and Bound ou ramificar e limitar é um estilo de algoritmo que separa o problema em problemas menores e tenta resolver esse subproblema da forma mais otimizada que conseguir. Caso não seja encontrado um algoritmo eficiente para resolver o problema, esse subconjunto ($disjoint\ set[1]$) não será resolvido.

Ele é um paradigma de projeto de algoritmo geralmente usado para resolver problemas de otimização combinatória. Esses problemas são tipicamente exponenciais em termos de complexidade de tempo e podem exigir a exploração de todas as permutações possíveis no pior caso. *Branch and Bound* pode resolver esses problemas com relativa rapidez.

1.2 Quando usar

Ótimo uso para esse estilo de programação é em problemas de NP-Difícil [2] como:

- Problema de satisfatibilidade máxima
- Problema do caixeiro-viajante
- Filogenética computacional

Os três problemas tem o mesmo grande problema de não existir um algoritmo eficiente que o resolva diretamente. Dessa forma, *Branch and Bound* separaria esses problemas em problemas menores e tentaria resolver cada subconjunto de forma independente.

1.3 Exemplo

Vamos usar o problema da mochila abaixo para entender o Branch and Bound. "Dados duas matrizes de inteiros val[0..n-1] e wt[0..n-1] que representam valores e pesos associados a n itens, respectivamente. Descubra o subconjunto de valor máximo de val[] de forma que a soma dos pesos deste subconjunto seja menor ou igual à capacidade W da mochila."

Existem diferentes abordagens para resolver o problema acima, porém a solução *Branch and Bound* é o método mais adequado quando os pesos dos itens não são inteiros.

Como encontrar o limite para cada nó da mochila? A ideia é usar o fato de que a abordagem *Greedy* fornece a melhor solução para o problema da mochila fracionária. Para verificar se um determinado nó pode nos dar uma solução melhor ou não, calculamos a solução ótima (por meio do nó) usando a abordagem *Greedy*. Se a solução computada pela abordagem *Greedy* em si é mais do que a melhor até agora, então não podemos obter uma solução melhor por meio do nó.

Passo a passo do algoritmo:

- Classificar todos os itens em ordem decrescente de razão de valor por unidade de peso para que um limite superior possa ser calculado usando o Greedy Approach.
- Inicializar o lucro máximo, maxProfit = 0.
- Criar uma fila vazia, Q.

- Criar um nó fictício da árvore de decisão e enfileire-o em Q. O lucro e o peso do nó fictício são 0.
- Fazer o seguinte enquanto Q não estiver vazio:
 - I. Extrair um item de Q. Deixar o item extraído ser u.
 - II. Calcular o lucro do nó do próximo nível. Se o lucro for maior que maxProfit, atualizar o maxProfit.
 - III. Limite de cálculo do nó do próximo nível. Se o limite for maior do que maxProfit, adicione o nó do próximo nível a Q.
- Considerar o caso em que o nó do próximo nível não é considerado como parte da solução e adicione um nó à fila com o nível seguinte, mas peso e lucro sem considerar os nós do próximo nível.

A seguir está a implementação em C++ da ideia acima:

```
1 #include <bits/stdc++.h>
2 using namespace std;
3
4 // Estrutura para o item que armazena o peso e correspondente
5
6 // Valor do item
7 struct Item
8 {
9    float peso;
10    int valor;
11 };
12
13 // Estrutura do nó para armazenar informacões de decisão
14
15 // Arvore
16 struct Node
17 {
18    // Nível do nó na árvore de decisão
19    // Lucro dos nós no caminho da raiz para este nó (incluindo este nó)
```

```
// Limite superior do lucro máximo na subárvore
int nivel, lucro, limite;
  float peso;
23 };
25 bool cmp(Item a, Item b)
26 {
    double r1 = (double)a.valor / a.peso;
    double r2 = (double)b.valor / b.peso;
    return r1 > r2;
30 }
32 // Retorna o limite do lucro na subárvore enraizada em u.
33 // Esta função usa principalmente a solução Greedy para encontrar
      um limite superior no lucro máximo.
35 int limite(Node u, int n, int W, Item arr[])
  // se o peso superar a capacidade da mochila, devolva O como
      limite esperado
    if (u.peso >= W)
     return 0;
    // inicializar vinculado ao lucro pelo lucro atual
    int limite_lucro = u.lucro;
43
    // comece a incluir itens do índice 1 mais para o atual
    int j = u.nivel + 1;
    int pesoTot = u.peso;
    // verificar a condição do índice e a capacidade da mochila
    while ((j < n) && (pesoTot + arr[j].peso <= W))</pre>
50
      pesoTot += arr[j].peso;
51
      limite_lucro += arr[j].valor;
52
      j++;
53
    }
54
55
```

```
//Se k não for n, inclua o último item parcialmente para o limite
       superior do lucro
    if (j < n)
      limite_lucro += (W - pesoTot) * arr[j].valor /
                       arr[j].peso;
    return limite_lucro;
62 }
_{64} // Retorna o lucro máximo que podemos obter com a capacidade W
65 int knapsack(int W, Item arr[], int n)
    // classificando item com base no valor por unidade
    sort(arr, arr + n, cmp);
69
    // faca uma fila para atravessar o nó
    queue < Node > Q;
71
    Node u, v;
    u.nivel = -1;
    u.lucro = u.peso = 0;
    Q.push(u);
    //Extraia um por um item da árvore de decisão
    // calcula o lucro de todos os filhos do item extraído e continue
       salvando maxProfit
    int maxProfit = 0;
    while (!Q.empty())
      // Desenfileirar um nó
      u = Q.front();
      Q.pop();
      // Se for um nó inicial, atribua o nível 0
      if (u.nivel == -1)
        v.nivel = 0;
89
      // Se não houver nada no próximo nível
```

```
if (u.nivel == n - 1)
         continue;
93
       // Caso contrário, se não o último nó, então incremente o nível
       , calcular o lucro dos nós filhos.
       v.nivel = u.nivel + 1;
       // Tomando o item do nível atual adicionar atual peso e valor
       do nível para o nó u peso e valor
       v.peso = u.peso + arr[v.nivel].peso;
99
       v.lucro = u.lucro + arr[v.nivel].valor;
       // Se o peso acumulado for menor que {\tt W} e o lucro é maior do que
        o lucro anterior, atualizar maxprofit
       if (v.peso <= W && v.lucro > maxProfit)
         maxProfit = v.lucro;
104
       // Obtenha o limite superior do lucro para decidir se deve
106
       adicionar v a Q ou não.
       v.limite = limite(v, n, W, arr);
108
       // Se o valor vinculado for maior do que o lucro, então apenas
109
       empurre na fila para mais consideração
       if (v.limite > maxProfit)
110
         Q.push(v);
       //Faca a mesma coisa, mas sem tirar o item na mochila
113
       v.peso = u.peso;
114
       v.lucro = u.lucro;
115
       v.limite = limite(v, n, W, arr);
116
       if (v.limite > maxProfit)
117
         Q.push(v);
118
     }
119
120
     return maxProfit;
121
122 }
123
124 // Programa para testar a função acima
```

2 Backtracking

2.1 Conceito

Backtracking é um algoritmo genérico para encontrar alguns problemas computacionais, que vai incrementando os candidatos para a solução e se em algum momento for encontrado que algum dos candidatos não resolve o problema, então vai acontecer um "backtracking". Um "backtracking" é o processo de retornar e ignorar essa solução, uma vez que ela não é resolve o problema [5].

3 Quando usar

O backtracking é aplicado em alguns tipos de problemas específicos [6]. Ele é uma ferramenta importante para resolver problemas de satisfação de restrições, como palavras cruzadas, aritmética verbal, Sudoku e muitos outros quebracabeças. Frequentemente, é a técnica mais conveniente para análise, para o problema da mochila e outros problemas de otimização combinatória. Ele depende dos "procedimentos de caixa preta" fornecidos pelo usuário que definem o problema a ser resolvido, a natureza dos candidatos parciais e como eles são estendidos para candidatos completos. É, portanto, uma metaheurística em

vez de um algoritmo específico — embora, ao contrário de muitas outras metaheurísticas, seja garantido que encontrará todas as soluções para um problema finito em um período de tempo limitado [7].

Para alguns casos, o backtracking é usado para o problema de enumeração, a fim de encontrar o conjunto de todas as soluções viáveis para o problema. Por outro lado, o backtracking não é considerado uma técnica otimizada para resolver um problema. Ele encontra sua aplicação quando a solução necessária para um problema não tem limite de tempo.

3.1 Exemplo

Explicação de backtracking atravéz do problema do ciclo Hamiltoniano

O caminho hamiltoniano em um gráfico não direcionado é um caminho que visita cada vértice exatamente uma vez. Um ciclo hamiltoniano é um caminho hamiltoniano tal que existe uma aresta (no gráfico) do último vértice ao primeiro vértice do caminho hamiltoniano. Determine se um determinado gráfico contém Ciclo Hamiltoniano ou não. Se contiver, imprime o caminho. A seguir estão as entradas e saídas da função necessária.

Entrada do problema

Um gráfico de matriz 2D [V][V] onde V é o número de vértices no gráfico e o gráfico [V][V] é a representação da matriz de adjacência do gráfico. Um gráfico de valor [i][j] é 1 se houver uma borda direta de i para j, caso contrário, gráfico [i][j] é 0.

Saida do problema

Um caminho de matriz [V] que deve conter o Caminho Hamiltoniano. O caminho [i] deve representar o i^0 vértice no caminho hamiltoniano. O código também deve retornar falso se não houver um ciclo hamiltoniano no gráfico.

Algoritmo Backtracking

Cria uma matriz de caminho vazia e adiciona o vértice 0 a ela. Adiciona outros vértices, começando do vértice 1. Antes de adicionar um vértice, verifica se ele é adjacente ao vértice adicionado anteriormente e se já não foi adicionado. Se encontrarmos tal vértice, adicionamos o vértice como parte da solução. Se não encontrarmos um vértice, retornamos falso.

3.2 Exemplo de algoritmo:

```
2 # Algoritmo em python para resolver o problema do ciclo
      hamiltoniano com Backtracking
4 class Grafo():
      def __init__(self, vertices):
          self.grafo = [[0 for column in range(vertices)]
                               for row in range(vertices)]
          self.V = vertices
10 # Verifica se este vértice é um vértice adjacente do vértice
      adicionado anteriormente e não é incluído no caminho anterior
      def isSafe(self, v, pos, caminho):
13
          # Verifica se o vértice atual e o último vértice no caminho
14
       são adjacentes
          if self.grafo[ caminho[pos-1] ][v] == 0:
              return False
17
          # Verifica se o vértice atual ainda não está no caminho
          for vertex in caminho:
              if vertex == v:
                  return False
21
          return True
23
24
```

```
# Funcão recursiva para resolver o problema do ciclo
      hamiltoniano
      def hamCycleUtil(self, caminho, pos):
          # Caso base: se todos os vértices forem incluídos no
      caminho
          if pos == self.V:
29
              # O último vértice deve ser adjacente ao primeiro vé
31
      rtice no caminho para fazer um ciclo
              if self.grafo[ caminho[pos-1] ][ caminho[0] ] == 1:
                  return True
33
              else:
                  return False
35
36
          # Tenta vértices diferentes como um próximo candidato no
      ciclo hamiltoniano.
          # Não tentamos O como incluímos O como ponto de partida em
      hamCycle ()
          for v in range(1,self.V):
39
              if self.isSafe(v, pos, caminho) == True:
42
                  caminho[pos] = v
44
                  if self.hamCycleUtil(caminho, pos+1) == True:
45
                       return True
                  #Remove o vértice atual se não leva a uma solução
                  caminho[pos] = -1
49
          return False
51
52
      def hamCycle(self):
          caminho = [-1] * self.V
54
55
     # Vamos colocar o vértice O como o primeiro vértice no caminho.
      Se houver um ciclo hamiltoniano então o caminho pode ser
```

```
iniciado de qualquer ponto do ciclo, pois o gráfico não é
      direcionado
           caminho[0] = 0
58
           if self.hamCycleUtil(caminho,1) == False:
               print ("A solucao nao existe \n")
60
               return False
61
           self.printSolution(caminho)
63
           return True
      def printSolution(self, caminho):
66
           print ("A Solucão Existe: Seguindo ",
                     "é um ciclo hamiltoniano")
           for vertex in caminho:
69
               print (vertex, end = " ")
           print (caminho[0], "\n")
71
73 # Codigo do condutor
75 # Criacao do grafo 1 de teste
76 \text{ g1} = \text{Grafo}(5)
77 g1.grafo = [ [0, 1, 0, 1, 0], [1, 0, 1, 1, 1],
               [0, 1, 0, 0, 1,],[1, 1, 0, 0, 1],
               [0, 1, 1, 1, 0], ]
81 # Printa solucao
82 g1.hamCycle();
84 # Criacao do grafo 2 de teste
85 \text{ g2} = \text{Grafo}(5)
86 g2.grafo = [ [0, 1, 0, 1, 0], [1, 0, 1, 1, 1],
          [0, 1, 0, 0, 1,], [1, 1, 0, 0, 0],
          [0, 1, 1, 0, 0], ]
90 # Printa solucao
91 g2.hamCycle();
```

4 Relação entre $Branch\ and\ Bound\ e\ Backtracking$

5 Relação com a Abordagem Gulosa

5.1 Conceito

As abordagens gulosas são baseadas em tentar resolver um problema sem se importar com otimizações para que o resultado seja obtido rapidamente. O primeiro passo para conseguir uma solução eficiente para um problema é conseguir apenas uma solução para o problema, mesmo que não consiga rapidamente. Discussão sobre os tipos de formas de implementar o algoritmo de Fibonacci [11].

5.2 Exemplo de código

```
1 # Código de Fibonacci usando abordagem gulosa.
2 # Muitos elementos dentro da árvore de recursão
3 # serão recalculados inúmeras vezes
4 import time
6 # Código do fibonacci
  def fib(numero):
      if (numero <= 2):</pre>
          return 1
      return fib(numero-1) + fib(numero-2)
12
13
14 def timer(fib, num):
      start = time.time()
      fib(num)
      end = time.time()
      return end - start
20 # Escrevendo os tempos na tela
```

```
print(f'Fibonnaci de 10: {timer(fib, 10)}')
print(f'Fibonnaci de 15: {timer(fib, 15)}')
print(f'Fibonnaci de 20: {timer(fib, 20)}')
print(f'Fibonnaci de 30: {timer(fib, 30)}')
```

5.3 Complexidade

Devido ao fato desse algoritmo criar uma árvore e deslocar dentro dela vários nós são iguais e mesmo assim recalculados. Com isso o custo é $\mathcal{O}(n^2)$.

6 Relação com Programação Dinâmica

6.1 Conceito

A ideia inicial da progamação dinâmica está baseada em armazenar todas as operações que serão repetidas durante uma recursão. Dessa forma, se durante a recursão tiver um nó igual que já foi previamente calculado, não será necessário que o cálculo seja feito novamente. Em árvores criadas como o algoritmo de fibonacci em que muitos nós são iguais, todos eles serão calculados apenas uma vez [12].

6.2 Exemplo de código

```
# Código baseado na implementacão da free code camp
# Referência: https://youtu.be/oBt53YbR9Kk?t=210

import time

* Código do fibonacci
def fib(numero):
    if (numero <= 2):
        return 1

return fib(numero-1) + fib(numero-2)

* Versão do código usando programacão dinâmica com memoization
def fibMemo(numero, memo={}):</pre>
```

```
if (numero in memo):
          return memo[numero]
      if (numero <= 2):</pre>
          return 1
19
      memo[numero] = fibMemo(numero - 1, memo) + fibMemo(numero - 2,
      memo)
      return memo[numero]
21
22
23 def timer(fib, num):
      start = time.time()
24
      fib(num)
      end = time.time()
      return end - start
29 # Escrevendo os tempos na tela
30 print(f'Fibonnaci de 10: {timer(fib, 10)}')
print(f'Fibonnaci de 10 memoization: {timer(fibMemo, 10)}')
33 print(f'Fibonnaci de 15: {timer(fib, 15)}')
34 print(f'Fibonnaci de 15 memoization: {timer(fibMemo, 15)}')
36 print(f'Fibonnaci de 20: {timer(fib, 20)}')
37 print(f'Fibonnaci de 20 memoization: {timer(fibMemo, 20)}')
39 print(f'Fibonnaci de 30: {timer(fib, 30)}')
40 print(f'Fibonnaci de 500 memoization: {timer(fibMemo, 500)}')
```

6.3 Complexidade

Como o algoritmo armazena todas as equações já feitas, todas as operações são transformar de $\mathcal{O}(n^2)$ para $\mathcal{O}(n)$. Precisando apenas do tempo de encontrar o elemento dentro do dicionário do Python e retornando ele [13].

7 Relação com Divisão e Conquista

7.1 Conceito

Em ciência da computação, divide and conquer é um paradigma de projeto de algoritmo. Um algoritmo de divisão e conquista divide recursivamente um problema em dois ou mais subproblemas do mesmo tipo ou de tipo relacionado, até que se tornem simples o suficiente para serem resolvidos diretamente. As soluções para os subproblemas são então combinadas para fornecer uma solução para o problema original.

A técnica de dividir e conquistar é a base de algoritmos eficientes para muitos problemas, como classificação, multiplicação de grandes números, localização do par mais próximo de pontos e análise sintática.

Esta técnica pode ser dividida nas seguintes três partes:

- Dividir: Envolve a divisão do problema em subproblemas menores.
- Conquistar: Resolva subproblemas chamando recursivamente até que seja resolvido.
- Combinar: Combine os subproblemas para obter a solução final de todo o problema.

A grande relação entre o Divide and Conquer, o Branch and Bound e o Backtracking é o fato de todos serem de natureza recursiva devido a maneira em que suas estrategias são conceptualizadas. O Backtracking é uma otimização do brute-force, onde o algoritmo retorna quando percebe que não tem como achar a resposta pelo caminho atual, por isso ele na maioria das vezes é recursivo. O divisão e conquista divide o problema em subproblemas, usando a recursão para esse processo. Eles possuem a diferença de: O backtracking tenta fazer apenas parte da solução, em busca da solução ótima, já o divide and conquer sempre vai dividir o problema inteiro para a sua resolução.

A seguir estão alguns algoritmos padrão que seguem o algoritmo Di-

vide and Conquer:

Quicksort

• MergeSort

• Par de pontos mais próximo

Exemplo: Encontrar o elemento máximo e mínimo de um array:

Entrada: 70, 250, 50, 80, 140, 12, 14

Saída: o número mínimo em uma determinada matriz é: 12

O número máximo em uma determinada matriz é: 250

Abordagem: encontrar o elemento máximo e mínimo de um determinado array é um aplicativo para dividir para conquistar. Neste problema, encontraremos os elementos máximo e mínimo em um determinado array. Estamos usando uma abordagem de dividir e conquistar (DAC [14]) que tem três etapas:

dividir, conquistar e combinar.

Neste problema, estamos usando a abordagem recursiva para encontrar o máximo, onde veremos que apenas dois elementos sobraram e então podemos facilmente usar a condição, ou seja, if(a[indice] > a[indice + 1]). Na condição acima, verificamos a condição do lado esquerdo para descobrir o máximo. Agora, veremos a condição do lado direito para encontrar o máximo. Função recursiva para verificar o lado direito do índice atual de uma matriz. Agora, vamos comparar a condição e verificar o lado direito do índice atual de um determinado array. No programa fornecido, vamos implementar essa lógica para verificar a condição do lado direito no índice atual.

Para encontrar o mínimo, vamos implementar uma logica recursiva igual fizemos para achar o maximo.

7.2 Exemplo de algoritmo

18

```
_{2} # Funcão para encontrar o no máximo em um array.
3 def DAC_Max(a, index, 1):
      max = -1;
      if (index >= 1 - 2):
          if (a[index] > a[index + 1]):
               return a[index];
              return a[index + 1];
10
      # Lógica para encontrar o elemento máximo no array
12
      max = DAC_Max(a, index + 1, 1);
13
14
      if (a[index] > max):
15
          return a[index];
      else:
17
          return max;
20 # Funcão para encontrar o no minimo em um array.
21 def DAC_Min(a, index, 1):
      min = 0;
      if (index >= 1 - 2):
          if (a[index] < a[index + 1]):</pre>
              return a[index];
          else:
26
               return a[index + 1];
      # Lógica para encontrar o elemento minimo no array
29
      min = DAC_Min(a, index + 1, 1);
30
31
      if (a[index] < min):</pre>
          return a[index];
33
      else:
34
          return min;
37 # Codigo teste
38 if __name__ == '__main__':
```

```
# Definindo as variáveis
min, max = 0, -1;

# Inicializando o array
a = [70, 250, 50, 80, 140, 12, 14];

# Recursão - funcão DAC_Max chamada
max = DAC_Max(a, 0, 7);

# Recursão - funcão DAC_Max chamada
min = DAC_Min(a, 0, 7);

print("O número mínimo em um determinado array é : ", min);
print("O número maximo em um determinado array é : ", max);

[15]
```

7.3 Complexidade

A complexidade dos algoritmos de divisão e conquista, por conta de sua abordagem, podem ir de $\mathcal{O}n^2$ como um bubblesort para $n\log_2 n$ como um quicksort [16].

Referências

- [1] Geeks for Geeks, Disjoint Sets, acessado em 27/11/2021.
- [2] Wikipedia, NP-Hardness, acessado em 27/11/2021.
- [3] Geeks for Geeks, Knapsack using Branch and Bound acessado em 27/11/2021.
- [4] Geeks for Geeks, Implementation of 0/1 Knapsack using Branch and Bound, acessado em 27/11/2021.
- [5] Free Code Camp, Backtracking Algorithms Explained, acessado em 28/11/2021.
- [6] Wikipedia, Backtracking, acessado em 28/11/2021.

- [7] Baeldung, Backtracking Algorithms acessado em 28/11/2021.
- [8] Wikipedia, Knight's tour, acessado em 28/11/2021.
- [9] Geeks for Geeks, Backtracking Algorithms, acessado em 27/11/2021.
- [10] Geeks for Geeks, Hamiltonian Cycle Backtracking-6, acessado em 27/11/2021.
- [11] Stack Overflow, Discussion about Fibonacci's Greedy algorithm, acessado em 28/11/2021.
- [12] Geeks For Geeks, Dynamic Programing, acessado em 28/11/2021.
- [13] FreeCodeCamp, Dynamic Programing, acessado em 27/11/2021.
- [14] Wikipedia, Divide and Conquer Algorithm, acessado em 28/11/2021.
- [15] Geeks for Geeks, Divide and Conquer Algorithm Introduction, acessado em 28/11/2021.
- [16] Free Code Camp, Divide and Conquer Algorithm Meaning: Explained with Examples, acessado em 28/11/2021.