Introdução Linguagem de Programação Julia e ao pacote JuMP

Amanda Ferreira de Azevedo

Universidade Federal do Rio de Janeiro

13 de setembro de 2021



Repositório Github

https://github.com/afazevedo/learning-julia

Sumário

Conceitos Base

- 2 Instalações e Configurações
- 3 Formulações em Programação Inteira

- Lançada em 2012
- Atender requisitos da computação numérica de alto desempenho;
- Open source
- Possibilita chamada de funções em Python e C, por meio de APIs;
- ▶ Tipagem dinâmica

Documentação

```
https://docs.julialang.org/en/v1/
http://leandro.iqm.unicamp.br/m3g/main/didatico/
simulacoes/tutorial-Julia.pdf
```

Lançada em 2012;

- Atender requisitos da computação numérica de alto desempenho;
- Open source
- Possibilita chamada de funções em Python e C, por meio de APIs;
- Tipagem dinâmica

Documentação

```
https://docs.julialang.org/en/v1/
http://leandro.iqm.unicamp.br/m3g/main/didatico/
simulacoes/tutorial-Julia.pdf
```

- Lancada em 2012:
- Atender requisitos da computação numérica de alto desempenho;

Conceitos Base 000

- Lançada em 2012;
- ► Atender requisitos da computação numérica de alto desempenho;
- Open source;
- Possibilita chamada de funções em Python e C, por meio de APIs;
- ▶ Tipagem dinâmica

Documentação

```
https://docs.julialang.org/en/v1/
http://leandro.iqm.unicamp.br/m3g/main/didatico/
simulacoes/tutorial-Julia.pdf
```

- Lancada em 2012:
- Atender requisitos da computação numérica de alto desempenho;
- Open source;
- Possibilita chamada de funções em Python e C, por meio de APIs;

- Lançada em 2012;
- Atender requisitos da computação numérica de alto desempenho;
- Open source;
- Possibilita chamada de funções em Python e C, por meio de APIs;
- ▶ Tipagem dinâmica

Documentação

```
https://docs.julialang.org/en/v1/
http://leandro.iqm.unicamp.br/m3g/main/didatico/
simulacoes/tutorial-Julia.pdf
```

- Lançada em 2012;
- Atender requisitos da computação numérica de alto desempenho;
- Open source;
- Possibilita chamada de funções em Python e C, por meio de APIs;
- Tipagem dinâmica

Documentação:

```
https://docs.julialang.org/en/v1/
http://leandro.iqm.unicamp.br/m3g/main/didatico/
simulacoes/tutorial-Julia.pdf
```

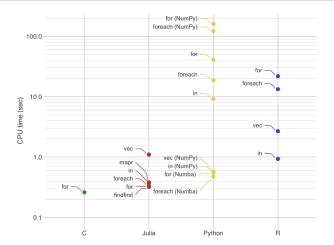


Figure 1: https://www.datasciencecentral.com/profiles/blogs/r-vs-python-vs-julia-how-easy-it-is-to-write-efficient-code

- É um dos pacotes para Julia;
- Formular diversos problemas de Otimização
- ► Tem um código "amigável";
- Permite o uso de diversos solvers

Documentação

- É um dos pacotes para Julia;
- Formular diversos problemas de Otimização;
- ► Tem um código "amigável";
- Permite o uso de diversos solvers

Documentação

- É um dos pacotes para Julia;
- Formular diversos problemas de Otimização;
- ► Tem um código "amigável";
- Permite o uso de diversos solvers

Documentação

- É um dos pacotes para Julia;
- Formular diversos problemas de Otimização;
- Tem um código "amigável";
- Permite o uso de diversos solvers

```
Documentação: https://iump.dev/JuMP.il/stable/
```

- É um dos pacotes para Julia;
- Formular diversos problemas de Otimização;
- Tem um código "amigável";
- Permite o uso de diversos solvers

Documentação:

Instalação do Julia

Download:

https://julialang.org/downloads/

Windows:

- Escolha por 64-bit ou 32-bit e faça o download
- Aperte no executável baixado e siga os procedimentos;

Linux:

- Escolha por generic Linux binaries on x86
- Mova o arquivo para o diretório home;
- Abra o terminal nessa pasta e utilize o comando: tar -xzf julia-1.6.2-linux-x86_64.tar.gz para descompactar

Guardem o caminho de instalação utilizado!

Instalação do Editor de Texto: Visual Studio Code

Download:

https://code.visualstudio.com/Download

Windows:

- Escolha por 64-bit ou 32-bit e faça o download;
- Aperte no executável baixado e siga os procedimentos

Linux:

- Escolha o .deb e faça o download
- Abra o terminal no diretório do arquivo, faça sudo dpkg -i nome_do_arquivo.deb e siga os procedimentos

Pacote Julia:

- ► Aperte *ctrl+shift+x* para acessar extensões
- Procure por "Julia" e instale o pacote
- Reinicie

Verificar nas configurações do pacote se o caminho está correto!

Instalação do Solver: Gurobi

Criar uma conta: https://pages.gurobi.com/registration

- Selecionar Academic;
- Preencha com seus dados pessoais: Em Company Email Address coloque o e-mail de sua universidade e em University o nome
- ► Em Academic Position selecione a opção Student
- ► Clique em *Access Now* e confirme em seu e-mail

Download:

- Clique em https://www.gurobi.com/login/ e logue com sua conta
- Clique em https:
 //www.gurobi.com/downloads/gurobi-optimizer-eula/ e
 aperte em I Accept the End User License Agreement

Windows:

Escolha Gurobi-9.1.2-win64.msi e faça o download

Linux:

Escolha o gurobi9.1.2_linux64.tar.gz

Siga os procedimentos abaixo para instalação: https://www.gurobi.com/wp-content/uploads/2021/04/README_ 9.1.2.txt

Instalação do Solver: Gurobi

Licença Acadêmica:

- Clique em https://www.gurobi.com/downloads/ end-user-license-agreement-academic/ e selecione a opção / Accept These Conditions
- Vá mais abaixo na página até a parte de Installation . Copie o código que começa com grbgetkey ...

Windows:

 Abra o Command Prompter ao digitar em pesquisa por cmd e cole esse código

Linux:

Cole o código diretamente no terminal

./grbgetkey ...

Configuração de Pacotes Esseciais

Criar um novo documento:

- Abrir o VScode;
- ► Clicar "ctrl + n" para abrir um novo arquivo
- ► Apertar "ctrl + s" para salvar
- Salve com ".jl" ao final, para identificar que é Julia

Instalação de pacotes:

- ▶ Digitar no documento using Pkg e apertar alt+enter para rodar
- Adicionar o JuMP: digite no Julia REPL abaixo Pkg.add("JuMP")
- Adicionar o Gurobi: digite no Julia REPL abaixo Pkg.add("Gurobi"), depois Pkg.build("Gurobi")

Após instalação, basta chamar as bibliotecas usando using

Example 1.1 (Wolsey 1998):

$$\begin{array}{ccc} \max & x_1 + 0.64x_2 \\ \text{s.t.} & 50x_1 + 31x_2 \leq 250 \\ & 3x_1 - 2x_2 \geq -4 \\ x_1, x_2 \geq 0, \text{ and interger} \end{array}$$

Solução usando programação linear:

$$(x_1, x_2) = (\frac{376}{193}, \frac{950}{193}) \approx (1.9, 4.9)$$

Solução ótima inteira: $(x_1, x_2) = (5, 0)$

Objetivo

Atribuir tarefas a pessoas ao menor custo total possível.

Variáveis

 $ightharpoonup x_{ij} \in \{0,1\}$: atribuição da tarefa j para a pessoa i

Restrições

- Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa: $\sum_{i=1}^{n} v_{i} = 1$
 - $\sum_{j=1}^{n} x_{ij} = 1 \quad \forall i = 1, \dots, n$
- Cada tarefa deve ser executada por uma única pessoa: $\sum_{i=1}^{n} y_{i} = 1$ $\forall i = 1$
- As variáveis x_{ii} são binárias 0-1:
- $x_{ii} \in \{0,1\}, \forall i=1,\ldots,n, \forall j=1,\ldots,r$

Função objetivo:

Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa: min $\sum_{i=1}^{n} \sum_{i=1}^{n} c_{ij} x_{ij}$

Objetivo

Atribuir tarefas a pessoas ao menor custo total possível.

Variáveis

 $\triangleright x_{ij} \in \{0,1\}$: atribuição da tarefa j para a pessoa i

Restrições

- ► Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa: $\sum_{i=1}^{n} x_{ii} = 1 \quad \forall i = 1, ..., n$
- Cada tarefa deve ser executada por uma única pessoa: $\sum_{i=1}^{n} x_{ii} = 1 \quad \forall i = 1, \dots, n$
- As variáveis x_{ij} são binárias 0-1: $x_{ij} \in \{0,1\}, \forall i = 1, \dots, n, \forall j = 1, \dots, n$

Função objetivo:

Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa: min $\sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} c_{ij} x_{ij}$

Objetivo

Atribuir tarefas a pessoas ao menor custo total possível.

Variáveis:

 $\triangleright x_{ii} \in \{0,1\}$: atribuição da tarefa *i* para a pessoa *i*

- Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa:
- Cada tarefa deve ser executada por uma única pessoa:
- As variáveis x_{ii} são binárias 0-1:

Objetivo

Atribuir tarefas a pessoas ao menor custo total possível.

Variáveis:

 $\triangleright x_{ii} \in \{0,1\}$: atribuição da tarefa *i* para a pessoa *i*

Restrições:

Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa:

$$\sum_{j=1}^{n} x_{ij} = 1 \quad \forall i = 1, \dots, n$$

Cada tarefa deve ser executada por uma única pessoa:

$$\sum_{i=1}^{n} x_{ij} = 1 \quad \forall j = 1, \dots, n$$

As variáveis x_{ii} são binárias 0-1:

$$\mathbf{x}_{ii} \in \{0,1\}, \forall i = 1, \dots, n, \forall j = 1, \dots, n\}$$

Objetivo

Atribuir tarefas a pessoas ao menor custo total possível.

Variáveis:

 $ightharpoonup x_{ij} \in \{0,1\}$: atribuição da tarefa j para a pessoa i

Restrições:

Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa:

$$\sum_{j=1}^{n} x_{ij} = 1 \quad \forall i = 1, \dots, n$$

Cada tarefa deve ser executada por uma única pessoa:

$$\sum_{i=1}^{n} x_{ij} = 1 \quad \forall j = 1, \dots, n$$

As variáveis x_{ij} são binárias 0-1:

$$\mathbf{x}_{ij} \in \{0,1\}, orall i=1,\ldots,n, orall j=1,\ldots,n$$

Função objetivo:

Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa: min $\sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} c_{ij} x_{ij}$

Objetivo

Atribuir tarefas a pessoas ao menor custo total possível.

Variáveis:

 $ightharpoonup x_{ij} \in \{0,1\}$: atribuição da tarefa j para a pessoa i

Restrições:

Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa:

$$\sum_{j=1}^{n} x_{ij} = 1 \quad \forall i = 1, \dots, n$$

Cada tarefa deve ser executada por uma única pessoa:

$$\sum_{i=1}^{n} x_{ij} = 1 \quad \forall j = 1, \dots, n$$

As variáveis x_{ij} são binárias 0-1:

$$x_{ij} \in \{0,1\}, \forall i = 1,\ldots,n, \forall j = 1,\ldots,n$$

Função objetivo:

► Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa: min $\sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{n} c_{ij} x_{ij}$

Objetivo

Atribuir tarefas a pessoas ao menor custo total possível.

Variáveis:

 $\triangleright x_{ii} \in \{0,1\}$: atribuição da tarefa *i* para a pessoa *i*

Restrições:

Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa:

$$\sum_{j=1}^{n} x_{ij} = 1 \quad \forall i = 1, \dots, n$$

Cada tarefa deve ser executada por uma única pessoa:

$$\sum_{i=1}^{n} x_{ij} = 1 \quad \forall j = 1, \dots, n$$

► As variáveis *x_{ii}* são binárias 0-1:

$$x_{ii} \in \{0,1\}, \forall i = 1,\ldots,n, \forall i = 1,\ldots,n$$

Função objetivo:

Cada pessoa deve efetuar uma única tarefa: min $\sum \sum c_{ij}x_{ij}$

 $x_i \in \{0,1\}$: 1 se considerar o item j, 0 caso contrário

O peso dos itens não pode ultrapassar b

$$\sum_{j=1}^{n} a_j x_j \le b$$

► Todas as variáveis x_i são binárias 0-1: $x_i \in \{0,1\}, \forall j = 1,...,n$

Retorno total deve ser maximizado max $\sum c_j x_j$

Objetivo

Selecionar um subconjunto de itens de máximo retorno sem exceder o orçamento disponível.

 $x_i \in \{0,1\}$: 1 se considerar o item j, 0 caso contrário

O peso dos itens não pode ultrapassar b

$$\sum_{i=1}^{n} a_j x_j \le b$$

► Todas as variáveis x_i são binárias 0-1: $x_i \in \{0,1\}, \forall j = 1,...,n$

Retorno total deve ser maximizado max $\sum c_j x_j$

Objetivo

Selecionar um subconjunto de itens de máximo retorno sem exceder o orçamento disponível.

Variáveis:

▶ $x_j \in \{0,1\}$: 1 se considerar o item j, 0 caso contrário

Restrições

O peso dos itens não pode ultrapassar *b*

$$\sum_{i=1} a_j x_j \le b$$

▶ Todas as variáveis x_j são binárias 0-1: $x_j \in \{0,1\}, \forall j = 1, ..., n$

Função objetivo

Retorno total deve ser maximizado max $\sum_{i=1}^{n} c_i x_i$

Objetivo

Selecionar um subconjunto de itens de máximo retorno sem exceder o orçamento disponível.

Variáveis:

▶ $x_j \in \{0,1\}$: 1 se considerar o item j, 0 caso contrário

Restrições:

▶ O peso dos itens não pode ultrapassar *b*

$$\sum_{j=1}^{n} a_j x_j \le b$$

▶ Todas as variáveis x_j são binárias 0-1: $x_j \in \{0,1\}, \forall j=1,\ldots,n$

Função objetivo

Retorno total deve ser maximizado max $\sum_{j=1}^{n} c_j x_j$

Objetivo

Selecionar um subconjunto de itens de máximo retorno sem exceder o orçamento disponível.

Variáveis:

▶ $x_j \in \{0,1\}$: 1 se considerar o item j, 0 caso contrário

Restrições:

▶ O peso dos itens não pode ultrapassar *b*

$$\sum_{j=1}^{n} a_j x_j \le b$$

▶ Todas as variáveis x_j são binárias 0-1: $x_j \in \{0,1\}, \forall j=1,\ldots,n$

Função objetivo:

Retorno total deve ser maximizado max $\sum_{j=1}^{n} c_j x_j$

Objetivo

Definir, ao mínimo custo, quais os centros de serviço abrir.

Matriz de incidência

▶ $a_{ij} \in \{0,1\}$: 1 se $i \in M$ pode ser atendida por $j \in N$

Variáveis

 $lacksquare x_j \in \{0,1\}$: se um centro deve ou não ser instalado em $j \in \mathcal{N}$

Restrições:

 $lackbox{}{lackbox{}{}}$ $i \in M$ deve ser coberta por pelo menos um $j \in N$

$$\sum_{j=1}^{n} a_{ij} x_j \ge 1, \quad i \in M$$

▶ Variáveis x_i são binárias 0-1: $x_i \in \{0,1\}, \forall j \in 1,...,n$

Função objetivo:

Custo de instalação de centros deve ser minimizado: min $\sum_{i=1}^{n} c_{i}x_{i}$

Objetivo

Definir, ao mínimo custo, quais os centros de serviço abrir.

Matriz de incidência

▶ $a_{ij} \in \{0,1\}$: 1 se $i \in M$ pode ser atendida por $j \in N$

Variáveis

- $x_j \in \{0,1\}$: se um centro deve ou não ser instalado em $j \in N$
- $igwedge i\in M$ deve ser coberta por pelo menos um $j\in N$ $\sum_{i=1}^n a_{ij}x_j\geq 1,\quad i\in M$
- Variáveis x_j são binárias 0-1: $x_j \in \{0,1\}, \forall j \in 1, ..., n$
- ightharpoonup Custo de instalação de centros deve ser minimizado: min $\sum_{j=1}^{n}c_{j}x_{j}$

Objetivo

Definir, ao mínimo custo, quais os centros de serviço abrir.

Matriz de incidência

▶ $a_{ij} \in \{0,1\}$: 1 se $i \in M$ pode ser atendida por $j \in N$

Variáveis

- $ightharpoonup x_j \in \{0,1\}$: se um centro deve ou não ser instalado em $j \in N$ Restrições:
 - $i \in M$ deve ser coberta por pelo menos um $j \in N$ $\sum_{i=1}^{n} a_{ij} x_{j} \geq 1, \quad i \in M$
- Variáveis x_j são binárias 0-1: $x_j \in \{0,1\}, \forall j \in 1,...,n$ Função objetivo:
 - ightharpoonup Custo de instalação de centros deve ser minimizado: min $\sum_{j=1}^{n} c_j x_j$

Objetivo

Definir, ao mínimo custo, quais os centros de serviço abrir.

Matriz de incidência

▶ $a_{ij} \in \{0,1\}$: 1 se $i \in M$ pode ser atendida por $j \in N$

Variáveis:

lacksquare $x_j \in \{0,1\}$: se um centro deve ou não ser instalado em $j \in N$

Restrições:

 $i \in M$ deve ser coberta por pelo menos um $j \in N$

$$\sum_{j=1}^{n} a_{ij} x_j \ge 1, \quad i \in M$$

 $lackbox{ Variáveis } x_j$ são binárias 0-1: $x_j \in \{0,1\}, \forall j \in 1,\ldots,n$

Função objetivo:

ightharpoonup Custo de instalação de centros deve ser minimizado: min $\sum_{j=1}^{n} c_j x_j$

Objetivo

Definir, ao mínimo custo, quais os centros de serviço abrir.

Matriz de incidência

▶ $a_{ij} \in \{0,1\}$: 1 se $i \in M$ pode ser atendida por $j \in N$

Variáveis:

 $lacksymbol{ iny} x_j \in \{0,1\}$: se um centro deve ou não ser instalado em $j \in \mathcal{N}$

Restrições:

▶ $i \in M$ deve ser coberta por pelo menos um $j \in N$

$$\sum_{j=1}^{n} a_{ij} x_j \ge 1, \quad i \in M$$

Variáveis x_j são binárias 0-1: $x_j \in \{0, 1\}, \forall j \in 1, ..., n$ Função objetivo:

Custo de instalação de centros deve ser minimizado: min $\sum_{j=1}^{n} c_j x_j$

Objetivo

Definir, ao mínimo custo, quais os centros de serviço abrir.

Matriz de incidência

 $ightharpoonup a_{ii} \in \{0,1\}$: 1 se $i \in M$ pode ser atendida por $j \in N$

Variáveis:

 $ightharpoonup x_i \in \{0,1\}$: se um centro deve ou não ser instalado em $j \in N$

Restrições:

 $i \in M$ deve ser coberta por pelo menos um $j \in N$

$$\sum_{j=1}^{n} a_{ij} x_j \ge 1, \quad i \in M$$

Variáveis x_i são binárias 0-1: $x_i \in \{0,1\}, \forall j \in 1,...,n$

Custo de instalação de centros deve ser minimizado: min $\sum c_i x_i$

Objetivo

Definir, ao mínimo custo, quais os centros de serviço abrir.

Matriz de incidência

▶ $a_{ij} \in \{0,1\}$: 1 se $i \in M$ pode ser atendida por $j \in N$

Variáveis:

lacksquare $x_j \in \{0,1\}$: se um centro deve ou não ser instalado em $j \in \mathcal{N}$

Restrições:

▶ $i \in M$ deve ser coberta por pelo menos um $j \in N$

$$\sum_{j=1}^{n} a_{ij} x_j \ge 1, \quad i \in M$$

▶ Variáveis x_i são binárias 0-1: $x_i \in \{0,1\}, \forall i \in 1,...,n$

Função objetivo:

lacktriangle Custo de instalação de centros deve ser minimizado: min $\sum_{j=1}^{n} c_j x_j$

- $y_i \in \{0,1\}, \forall j \in N$: abrir ou não um depósito em j.
- $x_{ii} \ge 0, \forall i \in M, j \in N$: fração da demanda do cliente i atendida

▶ 100% da demanda de $i \in M$ deve ser atendida:

$$\sum_{i \in N} x_{ij} = 1, \forall i \in M$$

ightharpoonup m é o número máximo de clientes que $j \in N$ pode atender:

$$\sum_{i \in M} x_{ij} \le m y_j, \forall j \in N$$

$$\min \sum_{i \in M} \sum_{i \in N} c_{ij} x_{ij} + \sum_{i \in N} f_j y_j$$

Objetivo

Minimizar os custos de instalações de depósitos e de transporte para suprir todos os clientes

Variáveis

- $\bigvee y_i \in \{0,1\}, \forall i \in \mathbb{N}$: abrir ou não um depósito em i.
- ▶ $x_{ij} \ge 0, \forall i \in M, j \in N$: fração da demanda do cliente i atendida pelo depósito j.

Restrições

▶ 100% da demanda de $i \in M$ deve ser atendida:

$$\sum_{i \in N} x_{ij} = 1, \forall i \in M$$

▶ m é o número máximo de clientes que $j \in N$ pode atender:

$$\sum_{i \in M} x_{ij} \le m y_j, \forall j \in N$$

Função objetivo:

Minimizar custos de instalação e de transporte

$$\min \sum_{i \in M} \sum_{i \in N} c_{ij} x_{ij} + \sum_{i \in N} f_j y_j$$

Objetivo

Minimizar os custos de instalações de depósitos e de transporte para suprir todos os clientes

Variáveis:

- ▶ $y_i \in \{0,1\}, \forall j \in N$: abrir ou não um depósito em j.
- $\mathbf{x}_{ij} \geq 0, \forall i \in M, j \in N : \text{fração da demanda do cliente } i \text{ atendida pelo depósito } j.$

Restrições:

▶ 100% da demanda de $i \in M$ deve ser atendida:

$$\sum_{i \in N} x_{ij} = 1, \forall i \in M$$

ightharpoonup m é o número máximo de clientes que $j \in N$ pode atender:

$$\sum_{i \in M} x_{ij} \le m y_j, \forall j \in N$$

Função objetivo:

Minimizar custos de instalação e de transporte

$$\min \sum_{i \in N} \sum_{j \in N} c_{ij} x_{ij} + \sum_{i \in N} f_j y_j$$

Objetivo

Minimizar os custos de instalações de depósitos e de transporte para suprir todos os clientes

Variáveis:

- ▶ $y_j \in \{0,1\}, \forall j \in N$: abrir ou não um depósito em j. ▶ $x_{ij} \geq 0, \forall i \in M, j \in N$: fração da demanda do cliente i atendida pelo depósito j.

Restrições:

▶ 100% da demanda de $i \in M$ deve ser atendida:

$$\sum_{i \in N} x_{ij} = 1, \forall i \in M$$

▶ m é o número máximo de clientes que $j \in N$ pode atender:

$$\sum_{i \in M} x_{ij} \le m y_j, \forall j \in N$$

$$\min \sum_{i \in \mathcal{N}} \sum_{j \in \mathcal{N}} c_{ij} x_{ij} + \sum_{i \in \mathcal{N}} f_i y_j$$

Objetivo

Minimizar os custos de instalações de depósitos e de transporte para suprir todos os clientes

Variáveis:

- ▶ $y_j \in \{0,1\}, \forall j \in N$: abrir ou não um depósito em j. ▶ $x_{ij} \geq 0, \forall i \in M, j \in N$: fração da demanda do cliente i atendida pelo depósito j.

Restrições:

▶ 100% da demanda de $i \in M$ deve ser atendida:

$$\sum_{i\in N} x_{ij} = 1, \forall i\in M$$

ightharpoonup m é o número máximo de clientes que $j \in N$ pode atender:

$$\sum_{i \in M} x_{ij} \le m y_j, \forall j \in N$$

Função objetivo:

Minimizar custos de instalação e de transporte:

$$\min \sum_{i \in M} \sum_{j \in N} c_{ij} x_{ij} + \sum_{i \in N} f_j y_j$$