# Algoritmo de Balas aplicado ao TSP com janelas de tempo e carro elétrico

#### 1 de agosto de 2025

Orientador: Álvaro Junio Pereira Franco - alvaro.junio@ufsc.br

Estudante: Felipe Lourenço da Silva - felipe.lourenco@grad.ufsc.br

Departamento: Informática e Estatística

Centro de ensino: Tecnológico

**Título do projeto:** Modelos e algoritmos para variações modernas do problema de roteamento de veículos

Fonte financiadora: Conselho Nacional de Desenvolvimento Científico e Tecnológico - Termo de Outorga - Processo: 405247/2023-0 (SIGPEX N. 202104940)

#### Resumo

Adaptamos o algoritmo de Balas que resolve o TSP com janelas de tempo para resolver o TSP com janelas de tempo e carro elétrico.

### O algoritmo de Balas

O algoritmo de Balas foi apresentado no artigo [1]. Uma implementação deste algoritmo foi apresentada em [2]. Vamos usar a mesma notação que aparece nos artigos citados. O grafo de entrada possui n vértices e é completo. As n cidades são indexadas por índices em  $N=\{1,2,\ldots,n\}$ . Muitas vezes escrevemos i como o índice da cidade i. Uma permutação  $\pi$  de  $1,2,\ldots,n$  é uma solução do TSP clássico. A posição da cidade i em uma solução viável do problema é denotado por  $\pi(i)$ . O grafo possui custos nas arestas  $t_{ij}$  que representam tanto a distância quanto o tempo entre os vértices i e j. O algoritmo de Balas resolve o TSP com a seguinte restrição: dado um inteiro positivo k e qualquer par de cidades i e j, se  $j \geq i + k$  então em qualquer solução viável do problema, a cidade i deve preceder a cidade j, ou seja,  $\pi(i) < \pi(j)$ . A este problema, vamos

nos referir como TSP restrito. O algoritmo consiste de uma redução do TSP restrito para o problema de encontrar um caminho de menor custo em um grafo dirigido acíclico.

Existem condições necessárias importantes (mas não suficientes) que valem destacar. A primeira delas determina as cidades candidatas a ocupar uma determinada posição em uma solução viável,  $\pi^{-1}$ . As cidades candidatas a ocupar a posição i de uma solução viável são aquelas dentro do intervalo de inteiros  $\{\max\{1,i-k+1\},\ldots,\min\{i+k-1,n\}\}$ . Podemos então escrever que uma cidade candidata  $\pi^{-1}(i)$  atende a seguinte restrição

$$\max\{1, i - k + 1\} \le \pi^{-1}(i) \le \min\{i + k - 1, n\}.$$

Para qualquer cidade j, a posição de j em uma solução viável também está definida dentro do seguinte intervalo de inteiros  $\{\max\{1, j-k+1\}, \ldots \min\{j+k-1, n\}\}$ , ou seja,

$$\max\{1, j - k + 1\} \le \pi(j) \le \min\{j + k - 1, n\}.$$

Portanto, dada a (i-1)-ésima visita do caixeiro viajante a algum vértice do grafo, o próximo vértice j a ser visitado poderá ser obtido através da construção de um grafo auxiliar considerando todas as possibilidades de vértices candidatos para a posição i (ou seja,  $\pi^{-1}(i) = \max\{1, i-k+1\}, \ldots, \min\{i+k-1, n\}$ ) e considerando todas as posições que uma cidade j pode ocupar (ou seja,  $\pi(j) = \max\{1, j-k+1\}, \ldots, \min\{j+k-1, n\}$ ). Caso alguma cidade candidata j para a posição i não esteja dentro do intervalo descrito acima, então essa cidade não deve ser considerada. Além disso, devemos ainda verificar a condição do TSP restrito: se  $j \geq i+k$  então  $\pi(i) < \pi(j)$ .

O grafo auxiliar  $G^*$  é construído com n+1 camadas. O conjunto de vértices da camada i do grafo auxiliar é denotado por  $V_i^*$ .  $V_1^* = \{s\}$  (vértice fonte s).  $V_{n+1}^* = \{t = s\}$  (vértice sorvedouro t que é igual a fonte s). O número de vértices de uma cada  $V_i^i$  é no máximo  $(k+1)2^{k-2}$  para  $i=2,\ldots,n$ . O grau de entrada de cada vértice do grafo auxiliar é no máximo k.

Em geral, a segunte recorrência calcula o custo de um segmento ótimo começando na cidade 1, passando pelas cidades de um subconjunto  $W \subset N$  nas posições  $2, \ldots, i-1$  e visitando a cidade j na posição i:

$$C(W, i, j) = \min_{l \in W} \{W \setminus \{l\}, i - 1, l\}.$$

No TSP clássico, existem muitas possibilidades para um conjunto W com i-2 elementos, a saber,  $\binom{n}{i-2}$ . No entanto, no TSP restrito, as possibilidades para W são poucas e descritas por pares de subconjuntos cujo tamanho de cada um é limitado por k. Os pares são:

$$S^{-}(\pi, i) := \{ l \in (1, \dots, n) : l \ge i, \pi(l) \le i - 1 \}$$
e
$$S^{+}(\pi, i) := \{ h \in (1, \dots, n) : h < i - 1, \pi(h) > i \}.$$

Descrevendo os conjuntos acima de outra forma,  $S^-(\pi,i)$  é o conjunto de cidades de uma solução viável  $\pi$  que possuem índices maiores ou iguais a i e

que foram visitadas em alguma posição  $1, \ldots, i-1$ , enquanto que  $S^+(\pi, i)$  é o conjunto de cidades de uma solução viável  $\pi$  que possuem índices menores ou iguais a i-1 e serão visitadas em alguma posição  $i, \ldots, n$ . É demonstrado que  $|S^-(\pi, i)| = |S^+(\pi, i)| \le |k/2|$ .

Um caminho de custo mínimo no grafo auxiliar passará por um vértice em cada camada do grafo. Um vértice deste caminho na camada i contém a cidade que é visitada na posição i da solução ótima. Um vértice na camada i do grafo auxiliar é denotado por  $(i,j,S_{ij}^-,S_{ij}^+)$  sendo j uma cidade candidata à posição i, e  $S_{ij}^-$  e  $S_{ij}^+$  sendo, respectivamente,  $S^-(\pi,i)$  e  $S^+(\pi,i)$ . A construção dos vértices  $(i,j,S_{ij}^-,S_{ij}^+)$  da camada  $V_i^*$  é realizada considerando todos os candidatos j para a posição i. Dessa forma, é possível obter todos os vértices da camada  $V_i^*$ . Os arcos de  $G^*$  conectam vértices de camadas consecutivas. Dois vértices,  $(i-1,l,S_{i-1,l}^-,S_{i-1,l}^+)$  e  $(i,j,S_{ij}^-,S_{ij}^+)$  são adjacentes (compatíveis) se cada caminho  $T_{i,j}$  em G que vai da cidade 1 até a cidade 1 na posição 1 pode ser obtido por um caminho 10 que vai da cidade 11 até a cidade 11 na posição 11. Ou seja, basta adicionar 12 ao caminho 13 para obter 14 para obter 15 svértices de um caminho 15 estão no conjunto 16 17 su para obter 18 con isso, vértices 19 vi é uma notação para o conjunto das cidades 11, 2, ..., 13. Com isso, vértices 15 vi e 15 são compatíveis se e somente se

$$N(i, j, S_{ij}^-, S_{ij}^+) = N(i - 1, l, S_{i-1,l}^-, S_{i-1,l}^+) \cup \{l\}.$$

Para obter os arcos de maneira eficiente, a última equação é expressa em termos dos conjuntos  $S_{ij}^-$ ,  $S_{ij}^+$ ,  $S_{i-1,l}^-$  e  $S_{i-1,l}^+$ .

**Proposição de Balas.** Os vértices  $(i-1,l,S_{i-1,l}^-,S_{i-1,l}^+)$  e  $(i,j,S_{ij}^-,S_{ij}^+)$  são adjacentes (compatíveis) se e somente se  $j \neq l$  e vale uma das seguintes condições.

- Se l < i-1 e  $i-1 \in S_{i-1,l}^-$ , então  $S_{ij}^- = S_{i-1,l}^- \setminus \{i-1\}$  e  $S_{ij}^+ = S_{i-1,l}^+ \setminus \{l\}$ .
- Se l < i-1 e  $i-1 \notin S_{i-1,l}^-$ , então  $S_{ij}^- = S_{i-1,l}^-$  e  $S_{ij}^+ = S_{i-1,l}^+ \setminus \{l\} \cup \{i-1\}$ .
- Se l = i 1, então  $S_{ij}^- = S_{i-1,l}^-$  e  $S_{ij}^+ = S_{i-1,l}^+$ .
- Se l>i-1 e  $i-1\in S_{i-1,l}^-,$  então  $S_{ij}^-=S_{i-1,l}^-\setminus\{i-1\}\cup\{l\}$  e  $S_{ij}^+=S_{i-1,l}^+.$
- Se l > i-1 e  $i-1 \notin S_{i-1,l}^-$ , então  $S_{ij}^- = S_{i-1,l}^- \cup \{l\}$  e  $S_{ij}^+ = S_{i-1,l}^+ \cup \{i-1\}$ .

Para finalizar, o custo de um arco entre os vértices  $(i-1, l, S_{i-1, l}^-, S_{i-1, l}^+)$  e  $(i, j, S_{ij}^-, S_{ij}^+)$  em  $G^*$  é o custo do arco entre os vértices l e j de G  $(c_{lj})$ .

O tempo de execução para resolver o problema do caminho mínimo no grafo auxiliar construído para o problema do TSP restrito é  $O(k^2 2^{k-2}n)$ . Ou seja, o

problema está é tratável quando o parâmetro k é fixo e pequeno (FPT - Fixed  $Parameter\ Tractable$ ).

Com isso, finalizamos a descrição do algoritmo de Balas para o TSP restrito. No entanto, Balas generalizou o algoritmo para o caso onde a restrição de que i preceda a cidade j em uma solução viável sempre que  $j \ge i + k(i)$ . Ou seja, cada vértice i pode ter um k diferente. Em seguida vamos descrever o algoritmos de Balas restrito e generalizado para este caso.

Para que uma posição de uma cidade j seja igual a i em uma solução viável  $(\pi(j) = i)$ , é necessário e suficiente que i esteja no seguinte intervalo  $\max\{1, j - |P_j|\} \le i \le \min\{n, j + k(j) - 1\}$ , sendo  $P_j = \{l \in N : l < j \in l + k(l) \ge j + 1\}$ .

Vamos acompanhar de perto a demonstração de Bala para as desigualdades acima.

**Necessidade.** Primeiro note que se  $i \geq j$ , então  $\max\{1, j - |P_j|\} \leq i$  é satisfeita. Se  $i \leq j$ , então  $i \leq \min\{n, j + k(j) - 1\}$  é satisfeita. Logo, falta mostrar que a primeira inequação é válida quando i < j e a segunda inequação é válida quando i > j.

Quando i>j, pelo princípio da casa dos pombos, é fato que teremos algum valor entre 1 e i-1 sendo a posição de alguma cidade l>i. Logo,  $\pi(j)>\pi(l)$  e assim

$$i < l < j + k(j) - 1,$$

sendo que a segunda desigualdade vale pois precisamos atender ao TSP restrito generalizado onde temos se  $\pi(l) \le \pi(j)$  então  $l \le j + k(j) - 1$ .

Quando i < j, então teremos  $\pi(l) > \pi(j)$  para j-i cidades l tais que l < j. Vamos ver o porquê. As cidades de  $N_{j-1}$  podem ocupar até i-1 posições k tal que  $\pi(k) < \pi(j)$ . As outras cidades de  $N_{j-1}$ , ou seja j-1-(i-1)=j-i cidades, ocupam posições depois de i. Dessa forma, para uma cidade l dentre essa j-i cidades, temos  $\pi(l) > \pi(j)$  como queríamos mostrar. Mas,  $\pi(l) > \pi(j)$  implica que  $j \le l + k(l) - 1$  (TSP restrito). Assim, o conjunto de cidades l < j tal que  $\pi(l) > \pi(j)$  é exatamente  $P_j$ . Portanto,  $|P_j| \ge j - i$  ou  $i \ge j - |P_j|$ .

**Suficiência.** Balas segue com a demonstração da suficiência construindo soluções viáveis com  $\pi(i) = i$ . Para mais detalhes, consulte [1].

Balas apresenta uma caracterização que determina o valor de  $\pi(i)$  dentro de um intervalo de números inteiros. Para que haja também uma caracterização determinando o valor de  $\pi^{-1}(i)$  (ou seja, os candidatos para a posição i) dentro de um intervalo de números inteiros, os valores k(i) precisam atender ao seguinte:  $k(i)-k(i+1) \leq 1$  para  $i=1,\ldots,n$ . Em geral, o que temos é a seguinte condição necessária mas não suficiente. Para qualquer solução viável do TSP restrito e generalizado,  $j_{(i)} \leq \pi^{-1}(i) \leq j^{(i)}$  para qualquer posição i desta solução sendo

$$j_{(i)} := \min\{j : j + k(j) \ge i + 1\},$$
$$j^{(i)} := \max\{j : j - i \le |P_i|\}.$$

Como esta condição em geral é necessária mas não suficiente, para evitar criar vértices que não estarão em qualquer solução viável do problema, é também necessário verificar a condição do TSP restrito e generalizado: ao criar um vértice  $(i,j,S_{ij}^-,S_{ij}^+)$ , devemos verificar para toda cidade l ainda não visitada (em  $S_{ij}^+$ ), a condição  $\pi(l) < \pi(j)$ , caso  $j \geq l + k(l)$ . No trabalho de Balas e Simonetti [2], os autores apresentam uma forma mais rápida para tratar este caso (veja sobre kthresh(v) no próximo parágrafo). Para nosso intuito, vamos trabalhar com o teste mais lento (verificar todos os vértices em  $S^+$ ), porém ainda polinomial no tamanho da entrada.

Um teste mais rápido para verificar se um vértice v do grafo construído pertence a alguma solução inviável pode ser feita através de um limitante denotado kthresh(v). Primeiro, é importante notar que um vértice  $v=(i,j,S_{ij}^-,S_{ij}^+)$  em uma solução viável do problema, implica que k(j) é maior que a diferença entre a cidade de maior índice em  $S^-$  e j (pois, l < j+k(j) para todo l em  $S_{ij}^-$  e assim,  $k(j) > \max\{S_{ij}^-\} - j$ . Para tratar  $S_{ij}^- = \emptyset$ , temos  $k(j) > \max\{0, \max\{S_{ij}^-\}\} - j$ . Dessa forma,  $kthresh(v) = 1 + \max\{0, \max\{S_{ij}^-\}\} - j$ . Portanto, qualquer vértice  $v=(i,j,S_{ij}^-,S_{ij}^+)$  tal que kthresh(v) > k(j) pertence a uma solução inviável e pode ser desconsiderado.

Para finalizar, agora vamos mostrar como Balas e Simonetti transformam o problema do TSP com janelas de tempos para o TSP restrito e generalizado. A ideia é usar as janelas para impor restrições de precedência: se  $j \geq i + k(i)$ , então  $\pi(i) < \pi(j)$ . Suponha que cada cidade i tenha janelas de tempo definidas no intervalo  $[a_i, b_i]$ . Considere também  $t_{ij}$ , o tempo de viagem de i até j. Em qualquer solução viável, uma cidade i tem que preceder uma cidade j se  $a_j + t_{ji} > b_i$ . Fixada uma cidade i, ao escolher a cidade j0 com menor índice tal que  $a_j + t_{ji} > b_i$  para toda cidade  $j \geq j_0$ , então podemos definir  $k(i) = j_0 - i$ . Para a cidade j0 com menor índice tal j0, então j0 en j1.

i	janela	$j_0 - i$	k
1			1
2	•	5 - 2	3
3	•	7 - 3	4
4	•	5 - 4	1
5	•	8 - 5	3
6	•	8 - 6	2
7	•	8 - 7	1

Figura 1: Caso com  $t_{ji}=0$ . Mesmo exemplo presente no trabalho de Balas e Simonetti.

Alterar a ordem das cidades pode alterar os k(i)'s encontrados. Quanto menor for  $k = \max_{i=1,\dots,n} \{k(i)\}$ , melhor será o desempenho do algoritmo, já que o tempo de execução depende exponenciamente de tal k. Balas e Simonetti comentam que encontrar tal k talvez seja NP-difícil [2].

# TSP com carro elétrico - *Electric Travaling Sa-lasmen Problem with Time Windows* (E-TSPTW)

A partir daqui, vamos também usar a notação presente no artigo de Roberti e Wen [3].

O conjunto de vértices é  $V = \{o, d\} \cup C \cup S$ , onde o é a origem d é o destino (uma cópia da origem), C é o conjunto de n clientes a visitar e S é o conjunto de m estações de recarga. Uma janela de tempo  $[e_i, l_i]$  é defida para a origem, destino, e elemento i de C. Tanto  $e_i$  quanto  $l_i$  são números inteiros positivos. As janelas de tempo são duras (hard), ou seja, um vértice i pode ser visitado antes de  $e_i$  mas não depois de  $l_i$ . As estações de recarga estão sempre disponíveis. Entre os vértices i e j de V temos a distância entre eles  $(d_{ij})$ , o tempo entre eles  $(t_{ij})$  e o consumo de bateria ao percorrer  $d_{ij}$   $(q_{ij})$ . Todos números inteiros positivos. O consumo de bateria é dado por  $q_{ij} = hd_{ij}$ , sendo h a taxa de consumo igual para todos os arcos do grafo de entrada. O tempo de recarga é linear em relação à quantidade a ser carregada (taxa de recarga é igual a g e vale para todas as estações). Em uma solução viável, uma recarga pode ser realizada muitas vezes em uma única estação. O vértice origem é também uma estação de recarga. No presente trabalho de iniciação científica, consideramos a recarga total da bateria. Mas existem trabalhos que consideram recarga parcial. Uma solução viável comeca na origem, termina no destino e passa por todos os clientes uma única vez, dentro da correspondente janela de tempo, podendo passar por estações de recarga. Em nenhum momento, a bateria pode acabar. A solução ótima é uma viável com a menor distância percorrida possível. Consideramos  $d_{ij} = t_{ij}$  para todo arco (i, j).

È importante destacar a seguinte propriedade do algoritmo de programação dinâmica de Balas. Dada que uma cidade foi visitada na posição i, o algoritmo considera todas as possíveis cidades que poderíam ocupar a posição i+1, ou seja, as cidade candidatas de  $\pi^{-1}(i+1)$ . No algoritmo de Balas, o caixeiro viajante sai de uma cidade u visitada na posição i e vai direto para a próxima cidade v na posição i+1. A adaptação do algoritmo de Balas para o E-TSPTW considera que o caixeiro ou vai direto de u para v; ou passa para recarregar a bateria em alguma estação de recarga. Lembre que denotamos por  $(i,j,S_{ij}^-,S_{ij}^+)$  um vértice do grafo auxiliar que visita a cidade j na posição i com os conjuntos  $S^-$  e  $S^+$  definidos em função da compatibilidade entre vértices do grafo. Para o caso do E-TSPTW, vamos denotar por  $(i,j,S_{ij}^-,S_{ij}^+,q,c)$ , sendo q a bateria do carro elétrico no vértice e c um custo neste vértice que corresponde a um caminho que começa na origem, termina em j e passa pelas cidades em  $\{N_i \backslash S_{ij}^+\} \cup S_{ij}^-$ . Outra forma de denotar a bateria e o custo em um vértice v do grafo

auxiliar é por q(v) e c(v), respectivamente. É importante notar que caminhos que iniciam na cidade 1, terminam na cidade w podem ter diferentes cargas de bateria e diferentes custos. Como neste caso estamos tratando a recarga de bateria, precisamos manter vértices que se poderiam se diferenciar somente na carga da bateria que o carro terá e no custo. O mapa da Figura 2 ilustra um exemplo. Observe na figura que temos o caminho  $u \to v \to x \to w$  e o caminho  $u \to x \to v \to w$ . No grafo auxiliar construído pelo algoritmo de Balas e adaptado para tratar o carro elétrico, teremos possivelmente dois vértices para representar estes dois caminhos. Denote por  $v'=(i,w,S_{iw}^{-v'},S_{iw}^{+v'},q^{v'},c^{v'})$  e  $u'=(i,w,S_{iw}^{-u'},S_{iw}^{+u'},q^{u'},c^{u'})$  tais vértices. Eventualmente, podemos remover um desses vértices do grafo auxiliar, caso  $S_{iw}^{-v'}=S_{iw}^{-u'}=S_{iw}^{+v'}=S_{iw}^{+u'}$ , então podemos eventualmente remover o vértice do grafo auxiliar correspondente ao caminho 1 (2), se  $q(v') \le q(u')$  e  $c(v') \ge c(u')$  ( $q(u') \le q(v')$  e  $c(u') \ge c(v')$ ), ou seja, caso foram percorridas as mesmas cidades em caminhos entre 1 e w, a bateria no vértice v' (u') é menor e o custo no vértice v' (u') é maior. Então, podemos eliminar o vértices no grafo auxiliar.

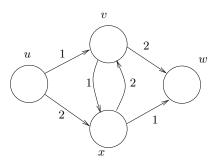


Figura 2: Dois caminhos de u para w com custo e consumo de bateria diferentes.

A seguinte descrição considera que o caixeiro viajante passa por no máximo um posto de recarga entre quaisquer duas cidades. Considere um vértice  $v'=(i,w,S^{-v'},S^{+v'},q,c)$  do grafo auxiliar, considere os seguintes postos de recarga  $\Delta_1,\Delta_2,\ldots,\Delta_k$  e considere que u é uma cidade candidata para a posição i+1. Pela construção do grafo auxiliar e considerando os postos de recarga, teremos no máximo k+1 novos vértices para a candidata u. Um vértice que denota o caixeiro viajante ir da cidade w até a cidade u sem passar por posto de recarga  $(i+1,u,S^{-u'},S^{+u'},q-q_{wu},c+d_{uv})$ . E outros k vértices que denota o caixeiro viajante ir da cidade w para a cidade u mas antes passando por algum posto de recarga  $(i+1,u,S^{-u'},S^{+u'},Q-q_{\Delta_1v},c+d_{w\Delta_1}+d_{\Delta_1u}),\ldots,(i+1,u,S^{-u'},S^{+u'},Q-q_{\Delta_kv},c+d_{w\Delta_k}+d_{\Delta_ku})$ . Note que todos os conjuntos  $S^-$  e  $S^+$  dos vértices criados são iguais e portanto podemos verificar a condição descrita anteriormente para todo par.

## Referências

- [1] Egon Balas. «New classes of efficiently solvable generalized traveling salesman problems». Em: Annals of Operations Research 86.0 (1999), pp. 529–558.
- [2] Egon Balas e Neil Simonetti. «Linear time dynamic-programming algorithms for new classes of restricted TSPs: A computational study». Em: *INFORMS journal on Computing* 13.1 (2001), pp. 56–75.
- [3] R. Roberti e M. Wen. «The electric traveling salesman problem with time windows». Em: *Transportation Research Part E: Logistics and Transportation Review* 89 (2016), pp. 32–52.