

Robustni problem nahrbtnika

Eva Babnik in Jan Založnik

December, 2020

Kazalo

1	Uvod	3
2	Povzetek	3
3	Problem nahrbtnika	4
4	Robustni problem nahrbtnika	4
5	Pristop z dinamičnim programiranjem	5
6	Opis kode	6
7	Optimizacija portfeljev s pomočjo RKP	7
8	Viri in literatura	9

Slike

1	<i>solve_RKP</i>	6
---	----------------------------	---

1 Uvod

Namen tega poročila je, da predstaviva robustni problem nahrbtnika in kodo s katero sva ga rešila. Kodo bova sproti ustrezno komentirala ter dodala njeno časovno zahtevnost. Vključila bova tudi nekaj primerov in zraven dodala še časovne vrednosti, ki jih je program potreboval za izračun rešitve. Program bova potem poskušala uporabiti na finančnem modelu. Podatke iz ameriške borze bova uporabila na kodi za robustni problem in tako poskušala sestaviti optimalni portfelj. Prav tako bova tudi tu dodala primere in njihovo časovno zahtevnost.

2 Povzetek

Poročilo se prične s kratko predstavitvijo navadnega oziroma klasičnega problema nahrbtnika in nato še z razlago robustnega problema nahrbtnika. V robustnem primer problema nahrbtnika prav tako kot pri klasičnem problemu iščemo množico predmetov, ki jih bomo položili v nahrbtnik in njihovo optimalno vrednost, vendar v tem primeru nimamo točnih podatkov o vseh težah predmetov. Za njihove teže vemo le, da so element določenega zaprtega intervala, ki torej ima zgornjo in spodnjo mejo. Poleg intervalov tež predmetov pa še vemo maksimalno število elementov, ki lahko spremeni svojo težo, to število označimo z Γ .

Za sledeči problem sva s pomočjo dinamičnega programiranja napisala rekurzivne enačbe, na katerih bazira najina koda v programskem jeziku *python*. Napisala sva program, ki reši tako klasični problem nahrbtnika kot tudi robustni problem nahrbtnika in za rešitev vrne optimalni seznam predmetov, ki jih položimo v nahrbtnik in skupno optimalno vrednost le-teh. Sestavila pa sva tudi enostavnejši grafični program, ki omogoča, da lahko problem reši tudi posameznik, ki nima nikakršnega predznanja v programiranju.

Nato sva kodo malo modificirala in jo uporabila na malo poenostavljenem finančnem modelu. Program prebere datoteko s podatki, ki zajemajo ceno delnice, najvišjo možno ceno delnice in letno stopnjo donosa, vrne pa optimalni portfelj, ki si ga lahko izberemo če imamo na voljo za investicije določeno vsoto denarja.

3 Problem nahrbtnika

Klasični problem nahrbtinka (angl. *classical Knapsack Problem*) je računalniški problem, s katerim poskusimo zapolniti nahrbtnik z danimi predmeti, ki ima vsak svojo ceno in težo. Bodisi gre za dejansko polnjenje nahrbtnika, polnjenje nakupovalne vreče ali morda zlaganje predmetov v avto. V nadaljevanju poročila bova za klasični problem uporabljala kar kratico KP. Na voljo imamo množico n -tih predmetov, ki jo označimo z $N = \{1, \dots, n\}$ in nahrbtnik s kapaciteto c . Vsak predmet ima pozitivno vrednost p_j in pozitivno utež w_j . Problem nahrbtnika nas sprašuje, katero podmnožico predmetov iz N moramo položiti v nahrbtnik, da bo skupna vrednost le teh čim večja možna in da ne bo presegla nahrbtnikove kapacitete. Torej maksimiziramo skupno vrednost predmetov pri pogoju, da seštevek izbranih uteži ne presega nahrbtinkove zmogljivosti. Problem lahko predstavimo kot celoštevilski linearni program (CLP):

$$\begin{aligned} \max \quad & \sum_{j \in N} p_j x_j \\ \text{s.t.} \quad & \sum_{j \in N} w_j x_j \leq c \\ & x_j \in \{0, 1\}, j \in N \end{aligned}$$

Kjer x_j zavzame vrednost 1, če j -ti predmet položimo v nahrbtnik, sicer zavzame vrednost 0.

4 Robustni problem nahrbtnika

Robustni problem nahrbtnika (angl. *Robust Knapsack Problem*) v nadaljevanju RKP, je nekakšna nadgranja problema nahrbtnika. Dodaten problem se pojavi pri točnosti naših podatkov, in sicer pri utežeh w_j . Vsak predmet j ima svojo nominalno težo w_j , ki pa je lahko netočna, ampak zanjo vemo, da se nahaja na intervalu $[w_j - \underline{w}_j, w_j + \overline{w}_j]$. Podan imamo tudi celoštevilski parameter Γ , ki označuje največje možno število predmetov z netočno izmerjeno težo. Pri iskanju rešitve problema moramo torej paziti, da bo seštevek vseh novih uteži še vedno manjši od kapacitete nahrbtnika. Težav z rešitvijo seveda ne bomo imeli, če bodo vse dejanske uteži nižje oziroma lažje od njene nominalne vrednosti, lahko pa se zgodi tudi najslabši možni izid, ko vse uteži zavzamejo zgornjo mejo intervala. Dopustno rešitev, kjer je $J \subseteq N$ lahko

formuliramo na naslednji način:

$$\sum_{j \in J} w_j + \sum_{j \in \hat{J}} \bar{w}_j \leq c, \quad \forall \hat{J} \subseteq J \text{ in } |\hat{J}| \leq \Gamma$$

5 Pristop z dinamičnim programiranjem

Naj bo $\bar{z}(d, s, j)$ najvišji dobiček za dopustno rešitev s skupno težo d , kjer so upoštevani samo elementi iz množice $\{1, \dots, j\} \in N$ in samo s izmed njih doseže zgornjo mejo \hat{w}_j . Naj bo $z(d, j)$ največji dobiček za dopustno rešitev s skupno težo d , kjer so upoštevani samo elementi iz množice $\{1, \dots, j\} \in N$ in naj jih le Γ spremeni težo iz nominalne na zgornjo mejo \hat{w}_j . Torej velja $d = 0, 1, \dots, c$; $s = 0, 1, \dots, \Gamma$ in $j = 0, 1, \dots, n$. Ključna lastnost pravilnosti tega pristopa je predpostavka, da so predmeti razvrščeni po padajoči teži \hat{w}_j . Problem lahko zapišemo z naslednjimi rekurzivnimi zvezami:

$$\begin{aligned} \bar{z}(d, s, j) = \max\{\bar{z}(d, s, j-1), \bar{z}(d - \hat{w}_j, s-1, j-1) + p_j\} \\ \text{za } d = 0, \dots, c; s = 1, \dots, \Gamma \text{ in } j = 1, \dots, n. \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} z(d, j) = \max\{z(d, j-1), z(d - w_j, j-1) + p_j\} \\ \text{za } d = 0, \dots, c \text{ in } j = \Gamma + 1, \dots, n. \end{aligned}$$

Začetna vrednost je $\bar{z}(d, s, 0) = -\infty$ za $d = 0, \dots, c$ in $s = 0, \dots, \Gamma$. Nato nastavimo $\bar{z}(0, 0, 0) = 0$. Oba zapisa sta med seboj povezana z enakostjo $z(d, \Gamma) = \bar{z}(d, \Gamma, \Gamma)$ za vsak d . Optimalno vrednost robustnega problema nahrbtnika dobimo kot:

$$z^* = \max \begin{cases} \max\{z(d, n) \mid d = 1, \dots, c \\ \max\{\bar{z}(d, s, n) \mid d = 1, \dots, c; s = 1, \dots, \Gamma - 1 \} \end{cases}$$

kjer porabimo tudi celotno kapaciteto nahrbtnika $c^* \leq c$.

Algoritem dinamičnega programiranja je sestavljen iz dveh korakov. V prvem koraku dobimo optimalno rešitev, ki vsebuje največ Γ elementov s povečano težo. V drugem koraku pa nato dobljeno rešitev lahko razširimo z dodatnimi elementi z nespremenjeno težo. Algoritem lahko razdelimo na dva koraka, ker razvrstitev predmetov po padajoči teži \bar{w}_j zagotavlja, da so v vsaki rešitvi elementi z najmanjšimi indeksi (torej tisti, ki so bili v nahrbtnik položeni prej) tisti, ki bodo dosegli večjo težo.

6 Opis kode

V prilogi sva dodala kodo napisano v *pythonu*, ki je ustrezno komentirana pri bolj zapletenih funkcijah, tukaj pa bova še podrobneje prikazala funkciji *solve_RKP* in *rekurzija*, ki sta glavni komponenti za izračun RKP.

```
1 def solve_RKP(N, c, w, p, gama = None, max_w = None):
2     najprej uredimo podatke po padajoči teži (max_w - w)
3     če je max_w = None, uredimo podatke padajoče po teži (w)
4     naredimo matrike Z, K, G ter nastavimo začetne pogoje
5     element v prvi vrstici in prvem stolpcu matrike nastavimo na 0 vse ostale na minus neskončno:
6     for d in range(c + 1):
7         for s in range(gama + 1):
8             Z[d][s] = float("-inf")
9     Z[0][0] = 0
10    analogno naredimo še matriki K in G
11    izberemo j-ti predmet:
12    for j in range(len(N)):
13        j-ti predmet poskusimo dodati v nahrbtnik v svoji nominalni teži pri pogoju, da smo že vstavili gama predmetov
14        for d in range(c, w[j]-1, -1):
15            if Z[d - w[j]][gama] + p[j] > Z[d][gama]:
16                Z[d][gama] = Z[d - w[j]][gama] + p[j]
17                K[d][gama] = 1 + K[d - w[j]][gama]
18                if j >= ((len(N) / 2)):
19                    G[d][gama] = 1 + G[d - w[j]][gama]
20        j-ti predmet poskusimo dodati v svoji robustni teži:
21        for s in range(gama, 0, -1):
22            for d in range(c, maks_w[j] - 1, -1):
23                if Z[d - maks_w[j]][s - 1] + p[j] > Z[d][s]:
24                    Z[d][s] = Z[d - maks_w[j]][s - 1] + p[j]
25                    K[d][s] = 1 + K[d - maks_w[j]][s - 1]
26                    if j >= ((len(N) / 2)):
27                        G[d][s] = 1 + G[d - maks_w[j]][s - 1]
28        največji člen matrike Z je z*:
29        z* = max([max(i) for i in Z])
30        pogledamo kje v matriki se nahaja z*:
31        pozicija = [[index, vrstica.index(z_zvedica)] for index, vrstica in enumerate(Z) if z_zvedica in vrstica]
32        vrstica ter stolpec maksimalne vrednosti predstavljata skupno težo vstavljenih predmetov:
33        c* = pozicija[0][0]
34        število_predmetov_s_povečano_tezo = pozicija[0][-1] #to je število predmetov, ki se jim je spremenila teža
35
36        najdemo k* ter gl, ki pomeni koliko elementov iz N2(druga polovica predmetov v N) je v optimalni rešitvi:
37        gl = G[c*][število_predmetov_s_povečano_tezo]
38        k* = K[c*][število_predmetov_s_povečano_tezo]
39        g* = k* - gl
40    return [z*, c*, k*, g*]
```

Slika 1: *solve_RKP*

Funkcija *solve_RKP* sprejme štiri obvezne argumente: množico predmetov N oblike $\{1, \dots, n\}$, kjer je n število predmetov; kapaciteto nahrbtnika c ; teže predmetov w ; vrednosti predmetov p in dva neobvezna argumenta Γ , ki označuje maksimalno število predmetov s spremenjeno težo ter $\bar{w} = \max_w$, ki prikazuje robustne teže predmetov. Vrne nam sledeče podatke: z^* (optimalna vrednost predmetov, ki bodo v nahrbtniku), c^* (optimalno težo predmetov v nahrbtniku), k^* (število predmetov, ki jih damo v nahrbtnik) ter g^* (število predmetov iz prve polovice množice N , ki jih dodamo v nahrbtnik).

Vse te optimalne vrednosti potrebujemo kasneje v funkciji *rekurzija*, da lahko dobimo seznam predmetov, ki jih bomo položili v nahrbtnik. V primeru ko ne podamo neobveznih argumentov Γ in max_w nam funkcija *solve_RKP* vrne podobne optimalne vrednosti kot prej, le da tokrat reši KP.

Optimalni seznam stvari, ki jih vstavimo v nahrbtnik sva dobila s pomočjo funkcije *rekurzija*, ki sprejme argumente $N, z^*, k^*, c^*, \Gamma, w, \bar{w}_j, p$ in neobvezen argument *rešitev*, pri čemer sva množico stvari N razdelila na dva dela: $N = N_1 \cup N_2$, za katera velja $N_1 = \{1, \dots, n/2\}$ in $N_2 = \{n/2 + 1, \dots, n\}$. Za primer ko je n liho število, pa sva za elemente množice N_1 vzela prvih $n/2 + 1$ predmetov. Po izračunu optimalne vrednosti s pomočjo funkcije *RKP* sva optimalni seznam stvari dobila rekurzivno za vsako množico stvari N_i , pri čemer sva si pomagala še z dvema funkcijama, pri katerih gre za različici problema nahrbtnika; s funkcijo *Solve_KP*, ki reši navadni problem nahrbtnika, ki je opisan na začetku poročila in s funkcijo *Solve_EkKP*, ki reši problem nahrbtnika z omejenim številom predmetov, ki je podoben navadnemu problemu nahrbtnika, le da tu dodamo še omejitev:

$$\sum_{i=1}^n x_i = k$$

kjer k pomeni dovoljeno število predmetov v nahrbtniku. Najna delitev problema da dva dela temelji na naslednji lemi:

Lema 1. Če je $k^* \geq \Gamma$, potem je optimalna rešitev sestavljena iz rešitve za robustni problem nahrbtnika s parametrom Γ za predmete iz množice N_1 in iz rešitve za navadni problem nahrbtnika za predmete iz množice N_2 , pri čemer upoštevamo njihove nominalne teže. V primeru ko je $k^* < \Gamma$, pa je optimalna rešitev sestavljena iz rešitev za *EkKp* s parametrom k^* za predmete iz množice N_1 z njihovimi maksimalnimi težami in iz rešitve za robustni problem nahrbtnika s parametrom $\Gamma - k^*$ za predmete iz množice N_2 .

7 Optimizacija portfeljev s pomočjo RKP

Kodo za robustni problem nahrbtinka sva nato uporabila na poenostavljenem finančnem modelu, kjer naju je zanimalo iz katerih delnic sestaviti optimalni portelj, pri čemer so cene delnic negotove.

Recimo, da imamo M delnic, pri čemer imamo za vsako delnico j na voljo ceno P_j , visoko ceno \bar{P}_j in nizko ceno \underline{P}_j , ter pričakovani donos delnice R_j . Zanima nas koliko delnic posameznega podjetja j kupiti, da bo pričakovani dobiček čim višji in da ob tem nakupu ne bomo presegli količine denarja B ,

namenjenega investiranju. Ob tem pa je potrebno tudi upoštevati, da največ Γ delnic spremeni svojo vrednost iz nominalne na maksimalno. Opisani primer lahko formuliramo na naslednji način:

$$\begin{aligned}
& \max \sum_{j \in M} P_j(1 + R_j)N_jx_j \\
& \sum_{j \in J} p_jN_jx_j + \sum_{j \in \hat{J}} \bar{P}_jN_jx_j \leq B, \quad \forall \hat{J} \subseteq J \text{ in } |\hat{J}| \leq \Gamma \\
& p_j \in [P_j - \underline{P}_j, P_j + \bar{P}_j] \\
& x_j \in \{0, 1\}, j \in M
\end{aligned}$$

Da bi dobila rešitev tega modela sva kodi dodala funkcije *preberi_podatke_zadehnice*,

Z zgoraj opisanim finančnim RKP modelom sva nato izračunala optimalni portfelj na podlagi o cenah in donosih delnic SP 500, kjer gre za 500 največjih in najbolj likvidnih ameriških podjetij, kjer sva iskala maksimalni donos portfelja glede na različne proračune B . Ob tem je potrebno poudariti, da veva, da dobljene rešitve niso najbolj optimalne, saj ostalih dejavnikov, ki močno vplivajo na sestavo optimalnega portfelja (kot je npr. tveganje), sploh nisva upoštevala. V rezultatu dobimo zelo nerazpršen portfelj, kar ni idealno, saj ravno z diverzifikacijo zmanjšujemo tveganje.

8 Viri in literatura

Literatura

- [1] *Michele Monaci, Ulrich Pferschy, Paolo Serafini*
<https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0305054813001342>