

# Projeto de Algoritmos Baseados em Florestas de Posets para o Problema de Otimização U-curve

MONOGRAFIA APRESENTADA  
AO  
INSTITUTO DE MATEMÁTICA E ESTATÍSTICA  
DA  
UNIVERSIDADE DE SÃO PAULO  
PARA  
APROVAÇÃO EM MAC499 – TRABALHO  
DE  
CONCLUSÃO DE CURSO

**Aluno:** Gustavo Estrela de Matos

**Orientador:** Marcelo da Silva Reis

Centro de Toxinas, Resposta-imune e Sinalização Celular (CeTICS)

Laboratório Especial de Ciclo Celular, Instituto Butantan

São Paulo, 16 de Novembro de 2017

# Resumo

A fazer.

# Conteúdo

<b>1</b>	<b>Introdução</b>	<b>1</b>
1.1	Objetivos do Trabalho . . . . .	3
1.2	Organização do Trabalho . . . . .	3
<b>2</b>	<b>Conceitos Fundamentais</b>	<b>4</b>
2.1	O problema de seleção de características . . . . .	4
2.2	Funções de custo . . . . .	4
2.3	O problema U-Curve . . . . .	6
2.4	Funções de custo artificiais . . . . .	6
2.4.1	Soma de subconjuntos . . . . .	7
2.4.2	Violação da curva U . . . . .	8
<b>3</b>	<b>Melhoramentos no Poset Forest Search</b>	<b>9</b>
3.1	Descrição do algoritmo . . . . .	9
3.1.1	O caso simples: U-Curve Branch and Bound . . . . .	9
3.1.2	O algoritmo Poset-Forest-Search . . . . .	11
3.1.3	Pseudo-código e detalhes de implementação do PFS . . . . .	14
3.2	Melhoramentos na escolha de raiz . . . . .	20
3.2.1	Escolha equiprovável . . . . .	20
3.2.2	Escolha de maior árvore . . . . .	21
3.3	Melhoramentos no controle de raízes . . . . .	21
3.3.1	Testes com instâncias artificiais . . . . .	22
3.4	Paralelização do código . . . . .	22
3.5	O algoritmo UBB-PFS . . . . .	23
<b>4</b>	<b>O algoritmo Parallel U-Curve Search</b>	<b>24</b>
4.1	Princípios . . . . .	24
4.2	Dinâmica . . . . .	25
4.2.1	Condições de poda . . . . .	25
4.2.2	Passeio aleatório no reticulado externo . . . . .	28
4.2.3	Solução das partes . . . . .	30
4.3	Parâmetros de funcionamento . . . . .	31
4.4	Implementação do algoritmo . . . . .	32
4.4.1	Controle do espaço de busca . . . . .	32
4.4.2	Paralelização do código . . . . .	32
4.5	Testes com instâncias artificiais . . . . .	32
4.5.1	Ajuste de parâmetros . . . . .	32
<b>5</b>	<b>Conclusão</b>	<b>34</b>

# Capítulo 1

## Introdução

Seleção de características é uma técnica que pode ser utilizada em uma das etapas da construção de um modelo de aprendizado de máquina. Ela consiste em, dado o conjunto de características observadas nas amostras, escolher um subconjunto que seja ótimo de acordo com alguma métrica. Devemos considerar o uso de seleção de características quando a quantidade de características é muito grande, o que pode tornar o uso do modelo muito caro do ponto de vista computacional. Outra aplicação dessa técnica é em situações nas quais a quantidade de amostras é pequena comparada à complexidade do modelo original, em outras palavras, quando ocorre sobreajuste (do inglês, *overfitting*).

Mais formalmente, o problema de seleção de características consiste em um problema de otimização combinatória em que, dado um conjunto  $S$  de características, procuramos por um subconjunto  $X \in \mathcal{P}(S)$  ótimo de acordo com uma função de custo  $c : \mathcal{P}(S) \rightarrow \mathbb{R}_+$ . É comum nas abordagens do problema explorar o fato de que o espaço de busca  $\mathcal{P}(S)$  junto a relação  $\subseteq$  define um reticulado Booleano [Rei12] [AG+18]. No geral, a função de custo  $c$  deve ser capaz de medir quão informativas as características  $X$  são em respeito ao rótulo  $Y$  do problema de aprendizado; portanto  $c$  costuma depender da estimação da distribuição de probabilidade conjunta de  $(X, Y)$ .

Quando ocorre a estimação da distribuição de probabilidade conjunta de  $(X, Y)$ , o custo das cadeias do reticulado Booleano reproduzem um fenômeno conhecido em aprendizado de máquina, o das “curvas em U”. Para entender intuitivamente esse fenômeno, devemos observar que conforme subimos uma cadeia do reticulado estamos aumentando o número de características sendo consideradas, portanto existem mais possíveis valores de  $X$ , permitindo descrever melhor os valores de  $Y$ ; por outro lado, também precisaríamos de mais amostras para estimar bem  $\mathbb{P}(X, Y)$ , e, quando isso não é possível, erros de estimação fazem com que  $c(X)$ , isto é, o custo de  $X$ , aumente.

Podemos então considerar um caso particular do problema de seleção de características em que a função de custo descreve “curvas em U” em todas as cadeias do reticulado Booleano. Esse caso particular é conhecido como problema U-curve e existem na literatura algoritmos ótimos para esse problema como o **U-Curve Branch and Bound (UBB)**, **U-Curve-Search (UCS)** e **Poset Forest Search (PFS)** [RFB14] [Rei12]. A solução do problema U-curve tem aplicações em problemas de aprendizado de máquina tais como como projeto de W-operadores [JCJB04] e preditores na estimação de Redes Gênicas Probabilísticas [Bar+07].

O problema U-Curve é NP-difícil [Rei12]; por conta deste fato, os algoritmos apresentados até então na literatura têm limitações tanto do ponto de vista de tempo de computação quanto do uso de memória. Dentre estes algoritmos, destacamos o PFS, que foi criado como um melhoramento do algoritmo UBB.

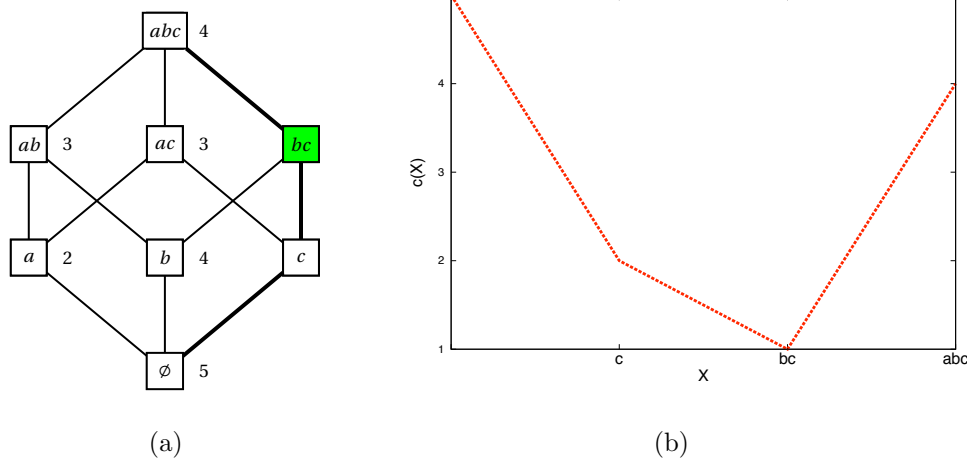


Figura 1.1: Exemplo de instância do problema U-curve em que o conjunto de características é  $S = \{a, b, c\}$ . A figura 1.1(a) representa o diagrama de Hasse do reticulado Booleano  $(\mathcal{P}(S), \subseteq)$ , anotando ao lado de cada conjunto de características o seu custo. Os custos dos elementos da cadeia  $\{\emptyset, c, bc, abc\}$ , marcada em negrito, são apresentados na figura 1.1(b). O subconjunto  $\{b, c\}$ , marcado em verde, tem custo mínimo na cadeia em negrito e também no reticulado inteiro e, portanto é a solução ótima para esta instância. Imagem retirada de [Rei12] com permissão do autor.

O UBB é um algoritmo *branch-and-bound* que, a partir de uma enumeração, representa o espaço de busca como uma árvore e procura pelo mínimo global fazendo uma espécie de busca em profundidade que percorre as cadeias da árvore do espaço de busca, podando nós (e consequentemente seus descendentes) sempre que a função de custo cresce. Este algoritmo é unidirecional no sentido de que a busca em profundidade percorre as cadeias da árvore de baixo para cima, portanto se o custo dos elementos de uma cadeia nunca crescem então todos elementos desta serão visitados. A limitação deste algoritmo é evidente quando a função de custo usada é monótona não-crescente, pois isto implica que a condição de poda nunca será verdadeira, fazendo com que todo o espaço de busca seja percorrido.

O algoritmo PFS contorna esta limitação porque é bidirecional. Para fazer isto, ele precisa representar o espaço de busca de duas maneiras diferentes: uma que é similar ao que o UBB faz, para os percorrimentos de baixo para cima, e outra que deve ser uma representação equivalente a primeira para o reticulado Booleano dual  $(\mathcal{P}(S), \supseteq)$ , para os percorrimentos de cima para baixo; ambas representações são feitas com florestas de posets, em uma estrutura de dados capaz de armazenar raízes e adjacências dos nós. Uma iteração do PFS é constituída das seguintes etapas: escolha de uma direção de percorrimento; escolha de uma raiz na floresta escolhida; ramificação (percorrimento de uma cadeia); poda na floresta escolhida; e por último, atualização da floresta dual a escolhida para que ambas representem o mesmo espaço de busca.

Existem pontos do algoritmo PFS que ainda não foram explorados com o intuito de melhorar seu desempenho. Dentre eles, a escolha de raízes para etapa de ramificação, que é feita de maneira arbitrária atualmente; o uso de outras estruturas de dados para representação das florestas, como por exemplo diagramas de decisão binárias ordenados (*Ordered Binary Decision Diagrams* - OBDDs) [Bry86]; e também a paralelização do código, o que parece trazer ganhos no tempo de execução do algoritmo dado que, como as árvores do espaço de busca são disjuntas, a etapa de ramificação pode ser realizada de maneira paralela com pouca informação compartilhada entre threads.

## 1.1 Objetivos do Trabalho

Podemos dividir os objetivos deste trabalho em objetivos gerais e específicos.

### Objetivos gerais:

1. Criar algoritmos para o problema U-curve que sejam mais eficientes em consumo de tempo e/ou de memória do que as presentes soluções;
2. Verificar a qualidade das soluções encontradas no desenvolvimento de modelos de Aprendizado Computacional.

### Objetivos específicos:

- Estudar o algoritmo `Poset Forest Search` (PFS);
- Modificar a etapa de ramificação do algoritmo PFS e avaliar as mudanças na dinâmica do algoritmo;
- Paralelizar o algoritmo PFS, com as modificações feitas na etapa de ramificação (se houver melhorias com tal mudança);
- Criar um novo algoritmo, de natureza paralela e facilmente combinável com outros algoritmos, para o problema U-Curve (o algoritmo PUCS);
- Avaliar o consumo de recursos computacionais dos algoritmos criados, comparando com os algoritmos já presentes na literatura como o UBB;
- Avaliar os conjuntos de características selecionados por cada algoritmo na seleção de modelos de aprendizado computacional, usando como exemplo conjuntos de dados do repositório UCI Machine Learning Repository.

## 1.2 Organização do Trabalho

A fazer, resumo de cada capítulo da monografia.

# Capítulo 2

## Conceitos Fundamentais

### 2.1 O problema de seleção de características

A seleção de características é um problema de otimização combinatória em que procuramos o melhor subconjunto de um conjunto de características  $S$ . O espaço de busca desse problema é o conjunto potência de  $S$ ,  $\mathcal{P}(S)$ , que é a coleção de todos os subconjuntos possíveis de  $S$ . A função de custo desse problema é uma função  $c : \mathcal{P}(S) \rightarrow \mathbb{R}_+$ .

**Definição 2.1.1** (Problema de seleção de características). *Seja  $S$  um conjunto de características, finito e não vazio, e  $c$  uma função de custo. Encontrar  $X \in \mathcal{P}(S)$  tal que  $c(X) \leq c(Y)$ ,  $\forall Y \in \mathcal{P}(S)$ .*

O espaço de busca do problema de seleção de características possui uma relação de ordem parcial definida pela relação  $\subseteq$ , portanto este conjunto é **parcialmente ordenado (poset)**.

**Definição 2.1.2.** *Uma **cadeia** do reticulado booleano é uma sequência  $X_1, X_2, \dots, X_l$  tal que  $X_1 \subseteq X_2 \subseteq \dots \subseteq X_l$ .*

### 2.2 Funções de custo

A função de custo utilizada na solução do problema deve, de alguma forma, refletir a qualidade do conjunto de características avaliado. Por isso, diferentes aplicações de seleção de características podem ter diferentes funções de custo. No contexto de aprendizado de máquina, uma possível função de custo é a entropia condicional média (MCE), que já foi utilizada por exemplo na construção de W-operadores [DMJ06].

**Definição 2.2.1.** *Dado um problema de aprendizado em que  $Y$  é o conjunto de possíveis rótulos e  $W = (w_1, \dots, w_n)$ , com  $w_i \in A_i$ , é o conjunto de variáveis. Seja  $W' = (w_{I(1)}, w_{I(2)}, \dots, w_{I(k)})$  um conjunto de variáveis (características) escolhidas,  $\mathbf{X}$  uma vetor aleatório de tamanho  $k$  com  $X_j \in A_{I(j)}$ , e  $\log 0 = 0$ . Então, a **entropia condicional** de  $Y$  dado  $\mathbf{X} = \mathbf{x}$  é:*

$$H(Y|\mathbf{X} = \mathbf{x}) = - \sum_{y \in Y} \mathbb{P}(Y = y|\mathbf{X} = \mathbf{x}) \log \mathbb{P}(Y = y|\mathbf{X} = \mathbf{x})$$

**Definição 2.2.2.** *Sob o mesmo contexto definido em 2.2.1, definimos a **entropia condicional média** como:*

$$\mathbb{E}[H(Y|\mathbf{X})] = \sum_{\mathbf{x} \in \mathbf{X}} H(Y|\mathbf{X} = \mathbf{x}) \mathbb{P}(\mathbf{X} = \mathbf{x})$$

A função  $H$ , em teoria da informação, mede o inverso da quantidade média de informação que uma variável tem. Esta função atinge valor máximo quando a distribuição de probabilidade da variável aleatória em questão é uniforme (todos valores que ela pode assumir são equiprováveis), e tem valores baixos quando essa distribuição é concentrada.

Problemas de aprendizado em que os rótulos tem uma distribuição concentrada são mais fáceis do que os problemas em que essa distribuição é menos concentrada. Tome como exemplo o problema de classificar o lançamento de uma moeda  $\mathbf{x}$  em  $y$  (cara ou coroa); se toda moeda  $\mathbf{x}$  é não viciada, então a distribuição de  $\mathbb{P}(y|\mathbf{x})$  é pouco concentrada, por outro lado, quando a moeda é viciada, a distribuição de  $\mathbb{P}(y|\mathbf{x})$  é concentrada e é mais fácil classificar este problema. Em termos mais formais, o erro do melhor classificador do problema mais fácil é menor do que o erro do melhor classificador do problema mais difícil.

Portanto, como a função  $H$  é capaz de medir a concentração da distribuição de  $Y$  dado  $\mathbf{X} = \mathbf{x}$ , e quanto maior esta concentração mais fácil é o modelo de aprendizado, podemos dizer que a função de custo  $\mathbb{E}[H(Y|\mathbf{X})]$  pode representar a qualidade do modelo de classificação que usa o conjunto de características de  $\mathbf{X}$ .

Agora, como já entendemos o funcionamento da função de custo MCE e como ela se relaciona com a qualidade do conjunto de características avaliado, vamos entender o que acontece no modelo de aprendizado e na função de custo que usamos como exemplo quando percorremos uma cadeia do reticulado.

Uma cadeia do poset pode ser vista como uma sequência de possíveis escolhas de conjuntos de características ao qual a cada passo adicionamos uma característica. Isso significa que a cada passo dado a variável  $\mathbf{x}$  ganha uma componente a mais. Quando estamos no início da cadeia, poucas variáveis do problema são consideradas, portanto há uma grande abstração dos dados dos objetos sendo classificados, e conforme subimos uma cadeia, diminuimos a abstração dos dados e isso faz com que a distribuição de  $Y$  dado  $\mathbf{x}$  se concentre.

Essa concentração da distribuição da probabilidade indica que o custo dos subconjuntos deve diminuir conforme subimos por uma cadeia do reticulado, e este raciocínio nos leva a pensar que adicionar características sempre melhora a classificação; de fato, o valor de  $\mathbb{E}[H(Y|\mathbf{X})]$  deve diminuir (até algum ponto de saturação) conforme aumentamos o número de variáveis do problema. Mas se isso é verdade, por que fazemos seleção de características? A inconsistência entre esse raciocínio e a motivação para seleção de característica é que essa linha de raciocínio negligenciou o fato de que problemas de classificação (supervisionada) dependem de uma amostra da distribuição de  $Y$  dado  $\mathbf{X} = \mathbf{x}$ , ou seja, não sabemos nem ao menos calcular  $H(Y|\mathbf{X} = \mathbf{x})$ , podemos apenas estimar o seu valor a partir da amostra.

A amostra da distribuição de  $Y$  dado  $\mathbf{X} = \mathbf{x}$  é obtida do conjunto de treinamento do problema de aprendizado e quando o número de amostras não é grande o suficiente a qualidade do classificador é comprometida. Além disso, o número de amostras necessárias deve crescer conforme aumentamos a complexidade do modelo de aprendizado utilizado. Considerando que quando subimos uma cadeia do reticulado booleano estamos aumentando a complexidade do modelo, temos que, a partir de um certo ponto, a qualidade do classificador que utiliza tal conjunto de características deve piorar.

Portanto, é esperado que a função de custo descreva um formato de U nas cadeias do reticulado. No começo da cadeia, o custo deve diminuir por conta da maior granularidade dos dados de entrada, até algum ponto onde a limitação no número de amostras combinada com o aumento da complexidade do modelo causem erros de estimação que aumentam o erro do classificador criado em tal modelo.

No cálculo da entropia condicional média, o efeito do aumento da complexidade de  $\mathbf{X}$  é a estimação ruim de  $\mathbb{P}(Y = y|\mathbf{X} = \mathbf{x})$ . Contorna-se este problema modificando a entropia



condicional média para penalizar a entropia de  $Y$  quando  $\mathbf{x}$  foi observado poucas vezes. A função de custo utilizada é, então:

$$\hat{\mathbb{E}}[H(Y|\mathbf{X})] = \frac{N}{t} \sum_{\mathbf{x} \in \mathbf{X}} H(Y|\mathbf{X} = \mathbf{x}) \mathbb{P}(\mathbf{X} = \mathbf{x})$$

## 2.3 O problema U-Curve

A função de custo apresentada na seção 2.2 descrevem curvas que tem um formato em U (a menos de oscilações) nas cadeias do reticulado booleano, vamos definir esta propriedade agora.

**Definição 2.3.1.** *Uma cadeia é dita **maximal** se não existe outra cadeia no reticulado que contenha propriamente esta cadeia.*

**Definição 2.3.2.** *Uma função de custo  $c$  é dita **decomponível em curvas U** se para toda cadeia maximal  $X_1, \dots, X_l$ ,  $c(X_j) \leq \max\{c(X_i), c(X_k)\}$  sempre que  $X_i \subseteq X_j \subseteq X_k$ ,  $i, j, k \in \{1, \dots, l\}$ .*

Vamos considerar então o problema de seleção de características em que a função de custo utilizada é decomponível em curvas U. Este é o problema central deste trabalho.

**Definição 2.3.3** (Problema U-Curve). *Dados um conjunto finito e não-vazio  $S$  e uma função de custo  $c$  decomponível em curvas em  $U$ , encontrar um subconjunto  $X \in \mathcal{P}(S)$  tal que  $c(X) \leq c(Y)$ ,  $\forall Y \in \mathcal{P}(S)$ .*

O problema U-Curve é um caso particular do problema de seleção de características com uma propriedade que nos permite achar o mínimo global sem a necessidade de avaliar cada ponto do reticulado booleano. Isso é possível porque a propriedade U-Curve (da decomponibilidade da função de custo em curvas U) nos garante que o custo dos elementos de uma cadeia não podem cair uma vez que aumentaram. Sejam por exemplo dois elementos  $A \subseteq B$  de  $\mathcal{P}(S)$ , então:

- se  $c(B) > c(A)$ , então  $c(X) > c(A)$  para todo  $X$  do intervalo  $[B, \mathcal{P}(S)]$ ;
- se  $c(A) > c(B)$ , então  $c(X) > c(B)$  para todo  $X$  do intervalo  $[\emptyset, A]$ ;

Desta maneira, quando um problema de seleção de características tem uma função de custo decomponível em curvas U a menos de algumas oscilações, é vantajoso aproximar a solução deste problema pela solução encontrada por um algoritmo de busca do problema U-Curve. Tal abordagem não é ótima, porém, como existem poucas oscilações da função de custo, é provável que a solução encontrada ainda seja próxima da melhor solução.

## 2.4 Funções de custo artificiais

Para testar e comparar o desempenho de algoritmos precisamos de muitas instâncias do problema U-Curve. Usar instâncias reais para este fim pode ser inviável devido a escassez de dados e, além disso, é possível isto cause uma análise viesada para os dados usados. Por isso é necessário usar funções de custo que nos permitam criar instâncias artificiais parecidas com problemas reais e que sejam tão gerais quanto possível, evitando que a avaliação dos algoritmos seja viesada.

Nesta seção apresentamos duas funções de custo artificiais, a primeira foi utilizada na maioria dos testes de desempenho dos algoritmos, servindo de base para avaliar tempo de execução,

otimalidade e número de chamadas da função custo. A segunda não foi utilizada em testes deste trabalho, mas foi objeto de estudos pois, diferente da primeira, é capaz de simular violações da hipótese de curva U, o que é esperado que ocorra mesmo que moderadamente em instâncias reais.

### 2.4.1 Soma de subconjuntos

Para se avaliar o desempenho dos algoritmos criados neste trabalho, utilizamos instâncias artificiais que são reduções do problema da soma de subconjuntos. Este problema consiste em, dado um conjunto finito de inteiros não-negativos  $S$  e um inteiro não-negativo  $t$ , descobrir se há um subconjunto de  $S$  que soma  $t$ . Podemos resolver este problema com a solução de uma instância do problema de seleção de características onde o conjunto de características é  $S'$  uma cópia de  $S$  e a função de custo é  $c$ :

$$c(X) = |t - \sum_{x \in X} x|, \text{ para todo } X \in \mathcal{P}(S').$$

Assim como a função de custo MCE, a função de custo de somas de subconjuntos também apresenta formato de curva em U nas cadeias do reticulado booleano. Para toda cadeia com elementos  $A \subseteq B \subseteq C$  vale que  $c(B) \leq \max\{c(A), c(C)\}$ , então de fato esta função é decomponível em curvas U. Vamos provar esta propriedade para dois casos disjuntos, quando  $|t - \sum_{b \in B} b| > 0$  e quando  $|t - \sum_{b \in B} b| \leq 0$ . Começamos a demonstração definindo  $D = B \setminus A$  e  $E = C \setminus B$ .

- se  $|t - \sum_{b \in B} b| > 0$ , então:

$$\begin{aligned} c(B) &= |t - \sum_{b \in B} b| \\ &\leq |t - \sum_{b \in B} b + \sum_{d \in D} d| \quad (\text{pois } S \text{ contém apenas números positivos e } t - \sum_{b \in B} b > 0) \\ &= |t - \sum_{a \in B \setminus D} a| \\ &= |t - \sum_{a \in A} a| \\ &= c(A) \end{aligned}$$

portanto,  $c(B) \leq c(A)$ , logo  $c(B) \leq \max\{c(A), c(C)\}$ .

- se  $|t - \sum_{b \in B} b| \leq 0$ , então:

$$\begin{aligned} c(B) &= |t - \sum_{b \in B} b| \\ &\leq |t - \sum_{b \in B} b - \sum_{e \in E} e| \quad (\text{pois } S \text{ contém apenas números positivos e } t - \sum_{b \in B} b \leq 0) \\ &= |t - \sum_{c \in B \cup E} c| \\ &= |t - \sum_{c \in C} c| \\ &= c(C) \end{aligned}$$

portanto,  $c(B) \leq c(C)$ , logo  $c(B) \leq \max\{c(A), c(C)\}$ .

Como acabamos de provar para os dois casos possíveis, temos que  $c(B) \leq \max\{c(A), c(C)\}$ . Desta maneira, a função de custo de soma de subconjuntos é decomponível em curvas U.  $\square$

### 2.4.2 Violação da curva U

Como vimos na seção 2.2.1, funções de custo utilizadas em problemas de seleção de características podem descrever curvas em formato de U nas cadeias do reticulado Booleano, e isto nos permite aproximar a solução destes problemas assumindo que a função de custo é decomponível em curvas U. Entretanto, é possível que as funções de custo apresentem oscilações, ou seja, mínimos locais. Por isso, é interessante estudar a robustez dos algoritmos que resolvem o problema U-Curve quando a hipótese de curva em U não é verdadeira. Apesar de não analisarmos os algoritmos deste trabalho quanto sua robustez, achamos importante citar esta métrica de qualidade.

Uma maneira de gerar funções com oscilações e violações da curva em U é adicionar uma perturbação senoidal a uma função decomponível em curvas U. Seja a seguinte função [AG+18]:

$$c(X|X_0, \mathbf{W}, c_{max}) = c_{max}[1 - e^{-\frac{1}{2}(X-X_0)^T \mathbf{W}(X-X_0)}]$$

em que,

$X \in \mathcal{P}(S)$  é um conjunto de características;

$X_0 \in \mathcal{P}(S)$  é o conjunto de custo mínimo;

$c_{max} \in \mathbb{R}$  é uma constante que escala o custo máximo de um subconjunto;

$\mathbf{W}$  é uma matriz positiva-definida de pesos que dá forma a função.

Adiciona-se então um ruído senoidal a esta função

$$c(X|X_0, \mathbf{W}, c_{max}) = c_{max}[1 - e^{-\frac{1}{2}(X-X_0)^T \mathbf{W}(X-X_0)}] + A \cos(2\pi f \beta(X))$$

$$\text{com } \beta(X) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n X(i)$$

em que,  $A \in \mathbb{R}$  é uma constante que regula a amplitude do ruído, ou seja, a profundidade dos mínimos locais; e  $f \in \mathbb{R}$  controla a frequência do ruído, isto é, qual a distância entre os mínimos locais gerados.

# Capítulo 3

## Melhoramentos no Poset Forest Search

Neste capítulo apresentamos o algoritmo **Poset Forest Search** (PFS), um algoritmo ótimo para o problema **U-Curve** que foi criado para enfrentar a limitação do algoritmo **U-Curve Branch and Bound** (UBB) ser unidirecional. Apesar do PFS ter solucionado tal problema com sucesso, este algoritmo apresenta pontos que ainda podem ser explorados para se criar uma modificação que tenha melhor desempenho computacional. Modificaremos então o PFS, explorando tais pontos.

Baseamos nosso trabalho no código já feito por Reis, que é software livre e está disponível no arcabouço *featsel* [Rei+17] sob a licença de uso *GNU General Public License*.

### 3.1 Descrição do algoritmo

#### 3.1.1 O caso simples: U-Curve Branch and Bound

O algoritmo **U-Curve Branch and Bound** (UBB), que é uma versão simplificada do PFS, percorre o espaço de busca fazendo uma busca em profundidade em uma árvore que é subgrafo do diagrama de Hasse do reticulado Booleano  $(\mathcal{P}(S), \subseteq)$ . Esta árvore é definida por aplicações recursivas do seguinte lema:

**Lema 3.1.1.** *Sejam  $X$  e  $Y$  conjuntos,  $X$  não-vazio e  $x_i$  o  $i$ -ésimo elemento de  $X$ . Seja  $X_0 \supseteq X_1 \supseteq \dots \supseteq X_{|X|}$  uma cadeia tal que  $X_0 = X$ ,  $X_{|X|} = \emptyset$  e  $X_i \cup \{x_i\} = X_{i-1}$  para todo  $0 < i \leq |X|$ . Vale que:*

$$\{Y\} \cup \bigcup_{i=1}^{|X|} \{W \cup Y \cup \{x_i\} : W \in \mathcal{P}(X_i)\} = \{W \cup Y : W \in \mathcal{P}(X)\}.$$

*Demonstração.* Faremos uma prova por indução no tamanho de  $X$  de maneira similar a Reis [Rei12].

- Suponha que  $|X| = 1$ . Então:

$$\begin{aligned} \{Y\} \cup \bigcup_{i=1}^1 \{W \cup Y \cup \{x_i\} : W \in \mathcal{P}(X_i)\} &= \{Y\} \cup \{W \cup Y \cup \{x_1\} : W \in \mathcal{P}(X_1)\} \\ &= \{Y\} \cup \{Y \cup \{x_1\}\} && \text{(Como } X_1 = \emptyset\text{)} \\ &= \{Y, Y \cup \{x_1\}\} \\ &= \{W \cup Y : W \in \mathcal{P}(X)\} \end{aligned}$$

- Suponha que o lema é verdadeiro para todo  $X$  com  $|X| < k$ , então:

$$\begin{aligned} \{Y\} \cup \bigcup_{i=1}^k \{W \cup Y \cup \{x_i\} : W \in \mathcal{P}(X_i)\} = \\ \{Y\} \cup \bigcup_{i=2}^k \{W \cup Y \cup \{x_i\} : W \in \mathcal{P}(X_i)\} \cup \{W \cup Y \cup \{x_1\} : W \in \mathcal{P}(X_1)\} \end{aligned}$$

Seja  $Z = Z_0 = X_1, Z_1 = X_2, \dots, Z_{|Z|} = X_{|X|}$ , então  $|Z| = k - 1$  e  $z_1 = x_2, z_2 = x_3, \dots, z_{|Z|} = x_{|X|}$ , e

$$\begin{aligned} \{Y\} \cup \bigcup_{i=2}^k \{W \cup Y \cup \{x_i\} : W \in \mathcal{P}(X_i)\} \cup \{W \cup Y \cup \{x_1\} : W \in \mathcal{P}(X_1)\} = \\ \{Y\} \cup \bigcup_{j=1}^{k-1} \{W \cup Y \cup \{z_j\} : W \in \mathcal{P}(Z_j)\} \cup \{W \cup Y \cup \{x_1\} : W \in \mathcal{P}(X_1)\} = \end{aligned}$$

(Pela hipótese de indução)

$$\begin{aligned} \{Y \cup W : W \in \mathcal{P}(Z)\} \cup \{W \cup Y \cup \{x_1\} : W \in \mathcal{P}(X_1)\} = \\ \{Y \cup W : W \in \mathcal{P}(X_1)\} \cup \{W \cup Y \cup \{x_1\} : W \in \mathcal{P}(X_1)\} = \\ \{Y \cup W : W \in \mathcal{P}(X_1 \cup x_1)\} = \\ \{Y \cup W : W \in \mathcal{P}(X)\} \end{aligned}$$

□

Para representar o espaço de busca como uma árvore, devemos aplicar o lema da seguinte forma. Vamos utilizar o conjunto  $X_Y$  para determinar para cada nó  $Y$  do reticulado quais são os nós alcançáveis por ele, de maneira que um nó  $Y$  pode alcançar todo nó do intervalo  $[Y, X_Y \cup Y]$ . Iniciamos a construção da árvore com a base da aplicação recursiva do lema, indicando que  $X_{Y=\emptyset} = S$ , pois  $\emptyset$  deve ser a raiz da árvore e deve alcançar qualquer outro nó. Agora suponha que estamos em um nó  $Y$ , então definimos  $X_0 = X_Y$ ,  $X_{Y_i} \cup \{x_i\} = X_{Y_{i-1}}$ , e  $Y_i = Y \cup \{x_i\}$  para  $x_i \in X_Y$ ; então para criar a sub-árvore com raiz  $Y$  basta adicionar os arcos  $(Y, Y_i)$  para cada  $i$  e aplicar o lema recursivamente para cada  $Y_i$  e  $X_{Y_i}$ . A figura 3.1 mostra uma árvore arbitrária gerada pela aplicação recursiva do lema.

A dinâmica do UBB é simples. Aplica-se o lema 3.1.1 para percorrer o espaço de busca enquanto o custo dos subconjuntos visitados se mantém ou diminui; quando o custo aumenta, podemos podar a sub-árvore que se inicia no nó onde o custo cresce. Por exemplo, em uma instância do problema U-Curve com três características, se o custo do nó  $Y = \{100\}$  é maior do que o custo de  $\{000\}$  e, ao visitar  $Y$ ,  $X = \{011\}$  então podemos remover do espaço de busca todos os nós do intervalo  $[100, 111]$ .

Uma vez entendido como as podas acontecem, é fácil perceber que o UBB precisa percorrer uma cadeia inteira (não há podas) quando o custo nela não aumenta até o penúltimo nó da cadeia. Portanto, se a função de custo é, por exemplo, monótona não-crescente, então a condição de poda nunca será verdadeira em qualquer cadeia do reticulado, logo todo o espaço de busca será visitado, como em uma busca exaustiva. Esta é a maior limitação do algoritmo UBB e foi para enfrentá-la que o algoritmo PFS foi criado.

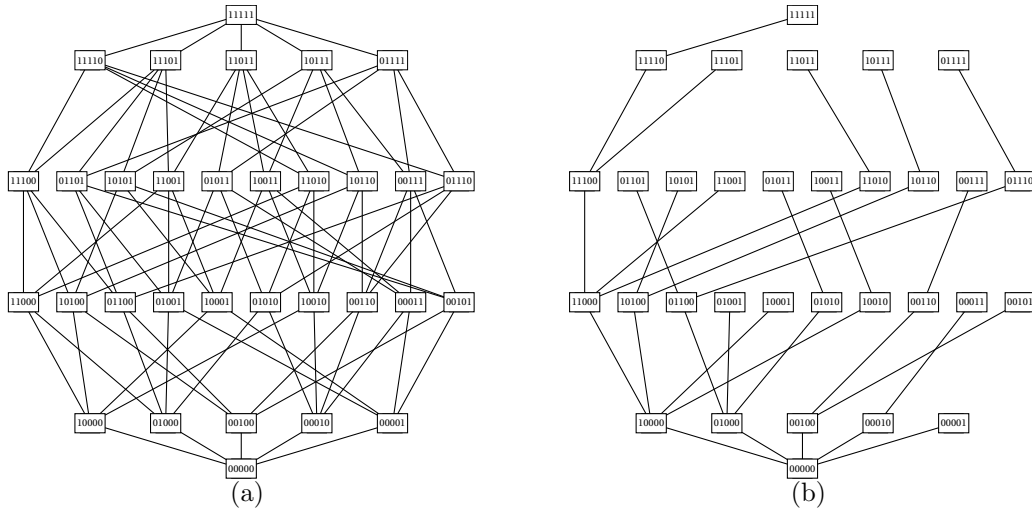


Figura 3.1: A figura 3.1(a) é o diagrama de Hasse do reticulado Booleano  $(\mathcal{P}(S), \subseteq)$  e a figura 3.1(b) é uma árvore de busca definida pelo algoritmo UBB.

U-CURVE-BRANCH-AND-BOUND  $(S, c)$

- 1:  $\mathcal{M} \leftarrow \text{BRANCH}(S, \emptyset, c, c(\emptyset))$
- 2: **return**  $\{M \in \mathcal{M} : c(M) \text{ é mínimo}\}$

BRANCH  $(X, Y, c, \text{cost}_Y)$

- 1:  $\mathcal{M} \leftarrow \{Y\}$
- 2: **while**  $X \neq \emptyset$  **do**
- 3:   remova um elemento  $x$  de  $X$
- 4:    $Y' \leftarrow Y \cup \{x\}$
- 5:    $\text{cost}_{Y'} \leftarrow c(Y')$
- 6:   **if**  $\text{cost}_{Y'} \leq \text{cost}_Y$  **then**
- 7:      $\mathcal{N} \leftarrow \text{BRANCH}(X, Y', c, \text{cost}_{Y'})$
- 8:      $\mathcal{M} \leftarrow \mathcal{N} \cup \mathcal{M}$
- 9:   **end if**
- 10: **end while**
- 11: **return**  $\mathcal{M}$

Algorithm 1: Pseudo-código do algoritmo UBB

### 3.1.2 O algoritmo Poset-Forest-Search

O algoritmo Poset-Forest-Search (PFS) é uma generalização do UBB capaz de percorrer o espaço de busca em duas direções, do menor para o maior elemento do reticulado (como o UBB) e também do maior elemento para o menor. Para fazer isso, o PFS inicia sua busca com duas árvores complementares, uma gerada por aplicações recursivas do lema 3.1.1 e outra, que representa o reticulado Booleano dual  $(\mathcal{P}(S), \supseteq)$ , gerada por aplicações recursivas do lema 3.1.2.

**Lema 3.1.2.** *Sejam  $X$  e  $Y$  conjunto,  $X$  não-vazio e  $x_i$  o  $i$ -ésimo elemento de  $X$ . Seja  $X_0 \supseteq X_1 \supseteq \dots \supseteq X_{|X|}$  uma cadeia tal que  $X_0 = X$ ,  $X_{|X|} = \emptyset$  e  $X_i \cup \{x_i\} = X_{i-1}$  para todo*

$0 < i \leq |X|$ . Vale que:

$$\{Y \cup X\} \cup \bigcup_{i=1}^{|X|} \{(X - (W \cup x_i)) \cup Y : W \in \mathcal{P}(X_i)\} = \{W \cup Y : W \in \mathcal{P}(X)\}.$$

A figura 3.2 mostra duas árvores do espaço de busca geradas pelo algoritmo. Note que estas árvores permitem o percorrimento do espaço de busca em duas direções. Observe também que na construção da árvore que percorre o reticulado do conjunto menor para o maior (figura 3.2(a)), o conjunto de nós alcançáveis por  $Y$  é determinado pelo intervalo  $[Y, X \cup Y]$ , e na árvore dual (figura 3.2(b)), construída por aplicações recursivas do lema 3.1.2 o conjunto de nós alcançáveis por  $Y$  é dado pela intervalo  $[Y \setminus X, Y]$ .

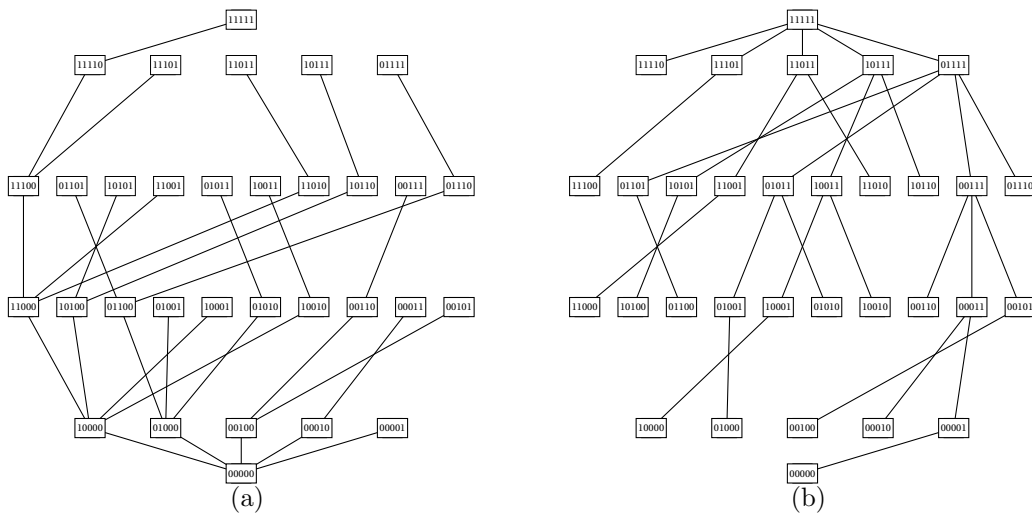


Figura 3.2: Exemplo de árvores do espaço de busca gerado pelo algoritmo PFS. A figura 3.2(a) mostra a árvore gerada por aplicações recursivas do lema 3.1.1 enquanto a figura 3.2(b) mostra a árvore gerada por aplicações recursivas do lema 3.1.2.

No algoritmo UBB o controle do espaço de busca pode ser facilmente implementado, pois basta não inserir a sub-árvore podada na pilha de busca em profundidade. No PFS, uma estratégia equivalente é capaz apenas de restringir nós da estrutura de dados que foi utilizada para o percorrimento de cadeias, ou seja, uma poda neste algoritmo implica na atualização das duas estruturas de dados que controlam o espaço de busca. Então, quando removemos um intervalo de uma árvore, precisamos remover este mesmo intervalo da árvore dual; como resultado, a árvore dual se torna uma **floresta**. Portanto, o PFS usa duas florestas para gerir o espaço de busca, uma com caminhos de conjuntos menores para maiores,  $\mathcal{F}_A$  e outra dual,  $\mathcal{F}_B$ . Um exemplo de atualização de árvore dual é apresentado na figura 3.3.

O PFS inicia escolhendo arbitrariamente uma direção de percorrimento e uma raiz da floresta correspondente a direção escolhida. O passo seguinte é a ramificação, que similar ao UBB percorre uma cadeia da árvore escolhida enquanto o custo dos subconjuntos não cresce e não chegamos em uma folha da árvore. Ao fim da fase de ramificação, suponha que feita na floresta  $\mathcal{F}_A$  ( $\mathcal{F}_B$ ), teremos um intervalo  $[Y, X \cup Y]$  ( $[Y \setminus X, Y]$ ) que precisa ser removido da floresta dual. Esta atualização da floresta dual é feita de acordo com as seguintes regras.

**Lema 3.1.3.** *Sejam  $T$  e  $T'$  duas árvores tais que  $T$  é complementar a  $T'$ . Eliminar de  $T'$  os vértices contidos no intervalo  $[Y, X \cup Y]$  é equivalente a remover de  $T'$  todos os vértices do caminho  $P$  de  $T$  com extremos  $Y$  e  $X \cup Y$  e também todos os vértices de  $T'$  contidos em*

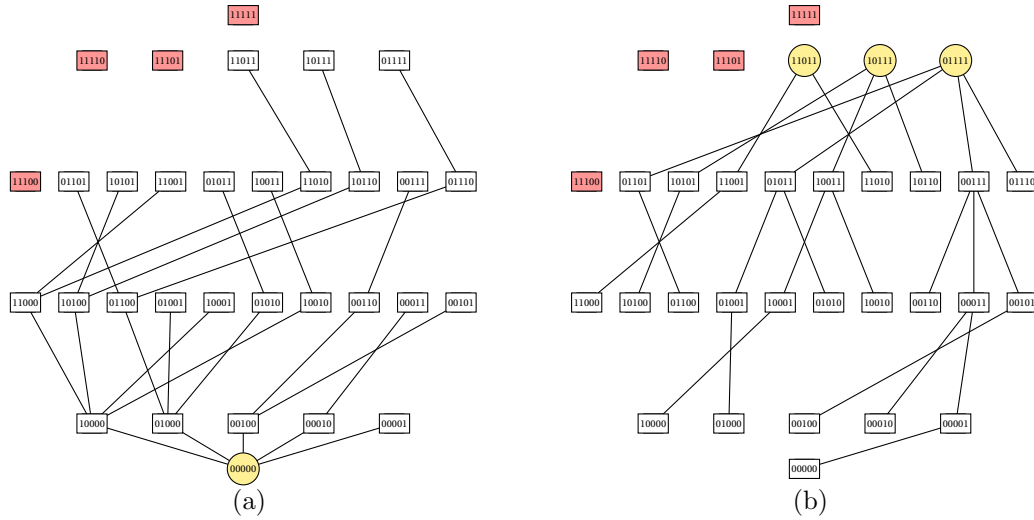


Figura 3.3: Exemplo de atualização de árvore após remoção de intervalo. Os nós em vermelho são removidos do espaço de busca enquanto os nós amarelos são raízes dos grafos. Removemos o intervalo  $[11100, 11111]$  da árvore da figura 3.3(a) e ao remover este mesmo intervalo da árvore dual, o grafo perde a raiz original (11111) e ganha as três raízes em amarelo.

intervalos  $[Y, B]$  tais que  $B$  contém propriamente  $Y$  e  $B$  é adjacente inferior a um vértice de  $P$ .

**Lema 3.1.4.** *Sejam  $T$  e  $T'$  duas árvores tais que  $T$  é complementar a  $T'$ . Eliminar de  $T$  os vértices contidos no intervalo  $[Y \setminus X, Y]$  é equivalente a eliminar de  $T$  todos os vértices do caminho  $P$  em  $T$  com extremos  $Y \setminus X$  e  $Y$  e também todos os vértices de  $T$  contidos em intervalos  $[A, Y]$  tais que  $A$  é contido propriamente em  $Y$  e  $A$  é adjacente superior a um vértice de  $P$ .*

As demonstrações dos lemas 3.1.3 e 3.1.4 estão disponíveis em Reis [Rei12].

O funcionamento do algoritmo deve seguir as seguintes regras:

- Inicialização das florestas:* as florestas  $\mathcal{F}_A$  e  $\mathcal{F}_B$  são iniciadas com as raízes  $\emptyset$  e  $S$  respectivamente.
- Representação de árvores:* para todo nó do espaço de busca que não foi removido e não é raiz na floresta, a sub-árvore que se inicia neste nó está completa no espaço de buscas. Desta forma, para representar a floresta precisamos apenas armazenar as raízes da floresta e suas adjacências, pois sabemos que cada vértice adjacente é raiz de uma subárvore completa.
- Gerenciamento das florestas:* durante a etapa de ramificação, um vértice visitado é podado ou torna-se raiz na floresta. Com isso, temos que todas arestas de um caminho percorrido são removidas da floresta.
- Condição de poda (dual):* no percorrimento de uma cadeia, se o nó  $Y$  da floresta  $\mathcal{F}_A$  ( $\mathcal{F}_B$ ) tem custo maior que o último nó visitado nesta cadeia, então removemos da floresta  $\mathcal{F}_A$  ( $\mathcal{F}_B$ ) a subárvore que começa em  $Y$ ,  $[Y, X \cup Y]$  ( $[Y \setminus X, Y]$ ). Se um nó  $Y$  visitado não tem conjuntos adjacentes no espaço de busca, então  $Y$  é removido do espaço de busca.



- e) *Atualização de floresta*: ao podar o intervalo  $[Y, X \cup Y]$  ( $[Y \setminus X, Y]$ ) da floresta  $\mathcal{F}_A$  ( $\mathcal{F}_B$ ), devemos remover os mesmos subconjuntos da outra floresta de acordo com o lema 3.1.3 (3.1.4).

### 3.1.3 Pseudo-código e detalhes de implementação do PFS

Apresentamos nesta seção um pseudo-código para o algoritmo e ao mesmo tempo comentamos como algumas destas soluções foram implementadas por Reis em *C++* no arcabouço *featsel*.

#### Definição de árvores de busca

Os algoritmos que descrevemos neste capítulo dependem da aplicação recursiva dos lemas 3.1.1 e 3.1.2, e para cada ordem de características  $x_i$  escolhida na aplicação do lema obtemos uma árvore diferente para representar o espaço de busca (veja figura 3.4). A implementação de Reis possui uma enumeração sobre as características que nos permite fixar os resultados da aplicação recursiva destes lemas e também facilita o controle das árvores da floresta. Supomos então que o conjunto de características  $S$  é uma lista ordenada  $\langle s_1, s_2, \dots, s_n \rangle$  e que é possível obter o índice de um elemento. Assim, sempre que fazemos a decomposição do espaço em uma árvore (com ambos lemas) escolhemos as variáveis do conjunto  $X$  em ordem crescente de índice.

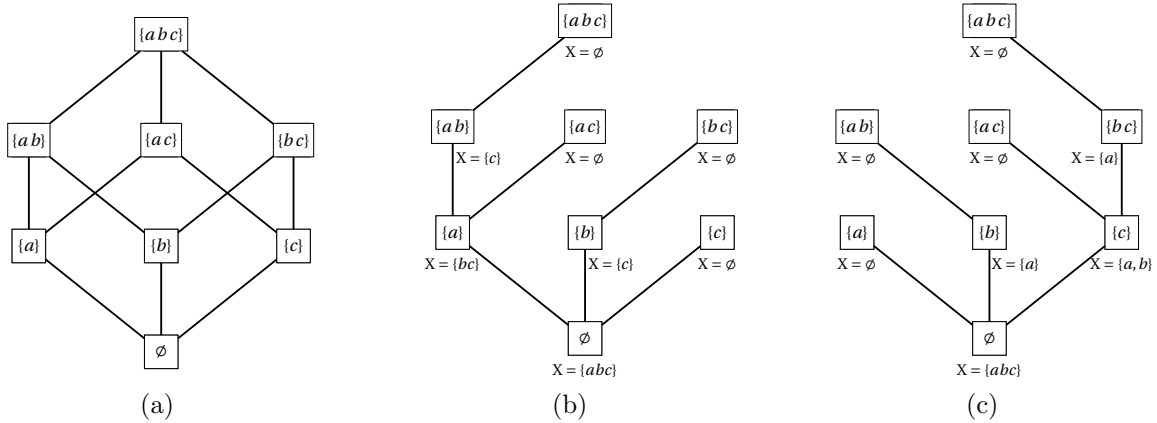


Figura 3.4: Exemplos de aplicações recursivas do lema 3.1.1 no reticulado booleano da figura 3.4(a). O conjunto  $X$  indica para cada subconjunto  $Y$  qual é o conjunto de nós de sua sub-árvore: exatamente os nós do intervalo  $[Y, X \cup Y]$ . Na figura 3.4(b) a decomposição elimina de  $X$  os elementos na ordem  $\langle a, b, c \rangle$  em todos os níveis de aplicação do lema, enquanto na figura 3.4(c) a ordem é  $\langle c, b, a \rangle$ .

#### Estrutura de dados

Vamos definir a estrutura de dados utilizada por Reis para representar nós das florestas. Um nó  $N$  é composto por quatro campos:

- **vertex**: armazena o conjunto de características que o nó representa.
- **adjacent**: armazena um conjunto de características que determina a adjacência do nó. Um nó  $N$  é adjacente aos conjuntos de características  $\{N[\text{vertex}] \cup \{x_i\} : x_i \in N[\text{adjacent}]\}$ .

- **leftmost**: um inteiro que define, pelo esquema de numeração, o conjunto de características  $X$  da decomposição em árvore do espaço de busca. Isto é, se  $Y = \mathbf{N}[\text{vertex}]$  então o conjunto de nós da sub-árvore com raiz  $Y$  deve ser igual ao intervalo  $[Y, X \cup Y]$ , se  $\mathbf{N}$  é da floresta  $\mathcal{F}_A$ , ou igual ao intervalo  $[Y \setminus X, Y]$  se  $\mathbf{N}$  é da floresta  $\mathcal{F}_B$ . Lembrando que assumimos uma ordem no conjunto de características  $(\langle s_1, s_2, \dots, s_n \rangle)$ ,  $X$  é definido como  $X = \bigcup_{i=\mathbf{N}[\text{leftmost}]}^n s_i$ .
- **cost**: um número em ponto flutuante que armazena o custo de  $\mathbf{N}[\text{vertex}]$ .

Como descrevemos na seção anterior, uma das regras do algoritmo garante que para representar as florestas precisamos apenas armazenar as raízes das florestas e suas listas de adjacências. Desta maneira, as duas florestas  $\mathcal{F}_A$  e  $\mathcal{F}_B$  são representadas por conjuntos de nós. Estes nós são armazenados na estrutura de *map* da linguagem C++.

### Pseudo-código

Vamos agora apresentar um pseudo-código do PFS em uma abordagem que mostra primeiro o todo e depois cada parte.

Uma iteração qualquer do PFS começa com a inicialização das florestas do espaço de busca. A floresta  $\mathcal{F}_A$ , que permite percorrimentos de baixo para cima no reticulado, é inicializada com a raiz  $\emptyset$  enquanto a floresta  $\mathcal{F}_B$ , de percorrimentos de cima para baixo, é inicializada com a raiz  $S$ . Assim que inicializadas as florestas, repetimos as etapas de escolha de direção de percorrimento, ramificação e poda das florestas até que ambas estejam vazias. Note que não importa qual floresta devemos verificar para terminar as iterações do algoritmo, já que ambas representam o mesmo espaço de busca, ou seja, quando uma floresta é vazia a outra também é.

POSET-Forest-SEARCH ( $S, c$ )

```

1:  $\mathcal{M} \leftarrow \emptyset$ 
2:  $\mathbf{T}[\text{vertex}] \leftarrow \emptyset$ 
3:  $\mathbf{T}'[\text{vertex}] \leftarrow S$ 
4:  $\mathbf{T}[\text{cost}] \leftarrow \mathbf{T}'[\text{cost}] \leftarrow \infty$ 
5:  $\mathbf{T}[\text{adjacent}] \leftarrow \mathbf{T}'[\text{adjacent}] \leftarrow S$ 
6:  $\mathbf{T}[\text{leftmost}] \leftarrow \mathbf{T}'[\text{leftmost}] \leftarrow 1$ 
7:  $\mathcal{F}_A \leftarrow \{\mathbf{T}\}$ 
8:  $\mathcal{F}_B \leftarrow \{\mathbf{T}'\}$ 
9: while  $\mathcal{F}_A \neq \emptyset$  do ▷ idêntico a  $\mathcal{F}_B \neq \emptyset$ 
10:    $direction \leftarrow \text{CHOOSE-DIRECTION}$ 
11:   if  $direction$  then
12:      $\langle \mathcal{N}, \mathcal{F}_A, \mathbf{N} \rangle \leftarrow \text{LOWER-FOREST-BRANCH}(\mathcal{F}_A, \mathcal{F}_B, c)$ 
13:      $\mathcal{F}_B \leftarrow \text{UPPER-FOREST-PRUNNING}(\mathcal{F}_B, \mathbf{N})$ 
14:   else
15:      $\langle \mathcal{N}, \mathcal{F}_A, \mathbf{N} \rangle \leftarrow \text{UPPER-FOREST-BRANCH}(\mathcal{F}_A, \mathcal{F}_B, c)$ 
16:      $\mathcal{F}_A \leftarrow \text{LOWER-FOREST-PRUNNING}(\mathcal{F}_A, \mathbf{N})$ 
17:   end if
18:    $\mathcal{M} \leftarrow \mathcal{M} \cup \mathcal{N}$ 
19: end while
20: return  $\{M \in \mathcal{M} : c(M) \text{ é mínimo}\}$ 

```

Algorithm 2: Pseudo-código do algoritmo PFS

A etapa de ramificação da floresta  $\mathcal{F}_A$  é feita pela função LOWER-Forest-BRANCH e consiste no percorrimento, a partir de uma raiz  $Y$ , de uma cadeia de sua sub-árvore. Nesta etapa, para manter válida a regra c) devemos remover todas as arestas do caminho percorrido e transformar todos os nós visitados e não podados em raízes da floresta. O percorrimento termina ao atingir um nó  $\mathbf{N}$  que é folha ou que possui custo maior do que seu precedente no caminho percorrido; então o intervalo  $[\mathbf{N}[\text{vertex}], \mathbf{N}[\text{vertex}] \cup \mathbf{N}[\text{adjacent}]]$  deve ser removido da floresta  $\mathcal{F}_A$ . Esta função retorna o nó  $\mathbf{N}$ , a floresta  $\mathcal{F}_A$  atualizada, e o conjunto  $\mathcal{M}$  de subconjuntos percorridos que são candidatos a mínimo.

CALC-NODE-COST ( $\mathcal{F}, \mathbf{N}$ )

- 1: **if**  $\mathbf{N}[\text{cost}] = \infty$  e existe  $\mathbf{M} \in \mathcal{F}$  tal que  $\mathbf{M}[\text{vertex}] = \mathbf{N}[\text{vertex}]$  e  $\mathbf{M}[\text{cost}] \neq \infty$  **then**
- 2:     **return**  $\mathbf{M}[\text{cost}]$
- 3: **else**
- 4:     **return**  $c(\mathbf{R}[\text{vertex}])$
- 5: **end if**

LOWER-Forest-BRANCH ( $\mathcal{F}_A, \mathcal{F}_B, c$ )

- 1:  $\mathcal{M} \leftarrow \emptyset$
- 2: remova um nó  $\mathbf{R}$  de  $\mathcal{F}_A$
- 3:  $\mathbf{R}[\text{cost}] \leftarrow \text{CALC-NODE-COST}(\mathcal{F}_B, \mathbf{R})$
- 4:  $\mathbf{M} \leftarrow \mathbf{N} \leftarrow \mathbf{R}$
- 5: **while**  $\mathbf{N}[\text{cost}] \leq \mathbf{M}[\text{cost}]$  e  $\mathbf{N}[\text{adjacent}] \neq \emptyset$  **do**
- 6:      $\mathbf{M} \leftarrow \mathbf{N}$
- 7:     remova um elemento de  $s_i$  de  $\mathbf{M}[\text{adjacent}]$
- 8:      $\mathcal{F}_A \leftarrow \mathcal{F}_A \cup \{\mathbf{M}\}$
- 9:     crie o nó  $\mathbf{N}$
- 10:     $\mathbf{N}[\text{vertex}] \leftarrow \mathbf{M}[\text{vertex}] \cup \{s_i\}$
- 11:     $\mathbf{N}[\text{leftmost}] \leftarrow i$
- 12:     $\mathbf{N}[\text{adjacent}] \leftarrow \bigcup_{i=\mathbf{N}[\text{leftmost}]}^n s_i$
- 13:     $\mathbf{N}[\text{cost}] \leftarrow \text{CALC-NODE-COST}(\mathcal{F}_B, \mathbf{N})$
- 14:     $\mathcal{M} \leftarrow \mathcal{M} \cup \{\mathbf{N}\}$
- 15: **end while**
- 16: **return**  $\langle \mathcal{M}, \mathcal{F}_A, \mathbf{N} \rangle$

*Algorithm 3: Continuação do pseudo-código 2, com a função que faz o percorrimento da floresta  $\mathcal{F}_A$ .*

A ramificação dual, da floresta  $\mathcal{F}_B$  é feita pela função UPPER-Forest-BRANCH e é similar a função LOWER-Forest-BRANCH ao percorrer uma cadeia da floresta de conjuntos maiores para conjuntos menores. A ramificação termina ao encontrar um nó  $\mathbf{N}$  que é folha da floresta ou tem custo maior que seu precedente no caminho; então o intervalo  $[\mathbf{N}[\text{vertex}] \setminus \mathbf{N}[\text{adjacent}], \mathbf{N}[\text{vertex}]]$  deve ser removido da floresta  $\mathcal{F}_B$  e todos os nós visitados, menos  $\mathbf{N}$  tornam-se raízes. Esta função retorna o nó  $\mathbf{N}$ , a floresta  $\mathcal{F}_B$  atualizada e o conjunto  $\mathcal{M}$  de subconjuntos percorridos que são candidatos a mínimo.

A atualização da floresta  $\mathcal{F}_B$  após o percorrimento e poda da floresta  $\mathcal{F}_A$  é feito pela função UPPER-FOREST-PRUNNING. Esta função recebe um nó  $N$  e deve remover os nós de  $\mathcal{F}_B$  de acordo com a regra e). Para fazer isto, percorremos o caminho  $P$  que liga os nós de subconjuntos  $N[\text{vertex}]$  e  $N[\text{vertex}] \cup N[\text{adjacent}]$  na floresta  $\mathcal{F}_B$ , removendo cada um dos nós deste caminho (se existirem) e chamando a função SEARCH-LOWER-CHILDREN para verificar se os filhos destes nós devem ser podados ou não. Ao fim do caminho chamamos a função SEARCH-UPPER-ROOT para achar, na floresta  $\mathcal{F}_B$ , a raiz que alcança este caminho; fazemos isto para atualizar a adjacência desta raiz e garantir que uma ramificação não vai inserir os nós removidos. Esta função devolve a floresta  $\mathcal{F}_B$  atualizada.

GET-NODE ( $\mathcal{F}, N$ )

```

1: if existe  $N \in \mathcal{F}$  tal que  $N[\text{vertex}] = N$  then
2:   return  $N$ 
3: else
4:   return  $NIL$ 
5: end if

```

UPPPER-FOREST-PRUNNING ( $\mathcal{F}_A, \mathcal{F}_B, N$ )

```

1:  $M \leftarrow N[\text{vertex}]$ 
2: while  $N[\text{adjacent}] \neq \emptyset$  do
3:    $M \leftarrow \text{GET-NODE}(\mathcal{F}_B, M)$ 
4:   if  $M \neq NIL$  then
5:     remova  $M$  de  $\mathcal{F}_B$ 
6:   end if
7:    $\mathcal{F}_B \leftarrow \text{SEARCH-LOWER-CHILDREN}(\mathcal{F}_B, M, M, N[\text{vertex}])$ 
8:   remova o elemento  $s_i$  de  $N[\text{adjacent}]$  com maior  $i$ 
9:    $M \leftarrow M \cup \{s_i\}$ 
10: end while
11:  $M \leftarrow \text{GET-NODE}(\mathcal{F}_B, M)$ 
12: if  $M = NIL$  then
13:    $\text{SEARCH-UPPER-ROOT}(\mathcal{F}_B, M)$ 
14: else
15:   remova  $M$  de  $\mathcal{F}_B$ 
16: end if
17:  $\mathcal{F}_B \leftarrow \text{SEARCH-LOWER-CHILDREN}(\mathcal{F}_B, M, M, N[\text{vertex}])$ 
18: return  $\mathcal{F}_B$ 

```

*Algorithm 4: Continuação do pseudo-código 3, com a função que faz a atualização da floresta  $\mathcal{F}_B$  depois de um percorrimento em  $\mathcal{F}_A$ .*

A atualização dual, da floresta  $\mathcal{F}_A$ , após o percorrimento e poda da floresta  $\mathcal{F}_B$  é feito pela função LOWER-FOREST-PRUNING e seu funcionamento é parecido com o de UPPER-FOREST-PRUNING. O caminho  $P$  de  $\mathcal{F}_A$  que deve ser removido tem as pontas  $N[\text{vertex}] \setminus N[\text{adjacent}]$  e  $N[\text{vertex}]$ , e a função SEARCH-UPPER-CHILDREN é chamada para verificar se os filhos destes nós devem ser podados ou não. Ao fim do caminho chamamos a função SEARCH-LOWER-ROOT para achar, na floresta  $\mathcal{F}_A$ , a raiz que alcança este caminho. Esta função devolve a floresta  $\mathcal{F}_A$  atualizada.

A função SEARCH-LOWER-CHILDREN é chamada para cada nó  $M$  do caminho  $P$ , como descrito no lema 3.1.3. Esta função verifica para todos os filhos  $B$  de  $M$  se  $B$  contém propriamente o conjunto  $\mathbf{N}[\text{vertex}]$ ; se contém, o nó de subconjunto  $B$  deve ser removido da floresta, caso contrário, um nó que representa este conjunto deve ser tornar raiz da floresta, pois o pai de  $B$  está sendo removido da floresta e isto significa que não haverá raiz que alcance  $B$ . Esta função devolve a floresta  $\mathcal{F}_B$  atualizada.

SEARCH-LOWER-CHILDREN ( $\mathcal{F}_B, \mathbf{M}, M, Y$ )

```

1:  $i \leftarrow n$ 
2: while  $i \geq 1$  e  $s_i \in M$  do
3:    $B \leftarrow M \setminus \{s_i\}$ 
4:   if  $B \supseteq Y$  then
5:      $\mathbf{B} \leftarrow \text{GET-NODE}(\mathcal{F}_B, M)$ 
6:     if  $\mathbf{B} \neq \text{NIL}$  then
7:       remova  $\mathbf{B}$  de  $\mathcal{F}_B$ 
8:     end if
9:   else
10:    crie o nó  $\mathbf{B}$ 
11:     $\mathbf{B}[\text{vertex}] \leftarrow B$ 
12:     $\mathbf{B}[\text{leftmost}] \leftarrow i + 1$ 
13:     $\mathbf{B}[\text{adjacent}] \leftarrow \bigcup_{i=\mathbf{B}[\text{leftmost}]}^n s_i$ 
14:     $\mathbf{B}[\text{cost}] \leftarrow \infty$ 
15:     $\mathcal{F}_B \leftarrow \mathcal{F}_B \cup \{\mathbf{B}\}$ 
16:   end if
17:    $i \leftarrow i - 1$ 
18:   return  $\mathcal{F}_B$ 
19: end while

```

*Algorithm 5: Continuação do pseudo-código 4*

SEARCH-UPPER-CHILDREN é a função dual de SEARCH-LOWER-CHILDREN e faz um procedimento similar, para cada nó  $\mathbf{M}$  do caminho  $P$ , como descrito no lema 3.1.4. Esta função verifica para todos os filhos  $A$  de  $M$  se  $A$  é contido propriamente pelo conjunto  $\mathbf{N}[\text{vertex}]$ ; se é, o nó de subconjunto  $A$  deve ser removido da floresta, caso contrário, o um nó que representa o conjunto  $A$  deve se tornar raiz da floresta. Esta função devolve a floresta  $\mathcal{F}_A$  atualizada.

A função SEARCH-UPPER-ROOT recebe um subconjunto  $M$  e a floresta  $\mathcal{F}_B$ . O objetivo desta função é remover arestas da floresta que podem levar ao conjunto  $M$ . Para isto, a função deve percorrer um caminho de  $M$  até uma raiz da floresta (de conjuntos menores para maiores), e esta raiz deve ter sua lista de adjacência atualizada, removendo a aresta que a comunica com  $M$ . Para garantir que removemos todas as arestas, devemos criar raízes para todos nós deste caminho mas sem a adjacência que os comunica com  $M$ . O funcionamento de SEARCH-LOWER-ROOT é similar, mas deve ocorrer em outra direção (de conjuntos maiores para menores).

SEARCH-UPPER-ROOT ( $\mathcal{F}_B, M$ )

```

1:  $i \leftarrow n$ 
2: while  $i \geq 1$  e  $s_i \in M$  do
3:    $i \leftarrow i - 1$ 
4: end while
5: while  $i \geq 1$  do
6:    $m \leftarrow s_i$ 
7:    $M \leftarrow M \cup \{m\}$ 
8:    $\mathbf{M} \leftarrow \text{GET-NODE}(\mathcal{F}_B, M)$ 
9:   if  $\mathbf{M} \neq \text{NIL}$  then
10:     $\mathbf{M}[\text{adjacent}] \leftarrow \mathbf{M}[\text{adjacent}] \setminus \{m\}$ 
11:     $i \leftarrow 0$ 
12:   else
13:     crie o nó  $\mathbf{M}$ 
14:     while  $i \geq 1$  e  $s_i \in M$  do
15:        $i \leftarrow i - 1$ 
16:     end while
17:      $\mathbf{M}[\text{leftmost}] \leftarrow i + 1$ 
18:      $\mathbf{M}[\text{adjacent}] \leftarrow \cup_{j=\mathbf{M}[\text{leftmost}]}^n \{s_j\} \setminus \{m\}$ 
19:      $\mathbf{M}[\text{cost}] \leftarrow \infty$ 
20:     adicione  $\mathbf{M}$  em  $\mathcal{F}_B$ 
21:   end if
22:   return  $\mathcal{F}_B$ 
23: end while

```

## 3.2 Melhoramentos na escolha de raiz

Reis utilizou a estrutura de *map* para armazenar as raízes das florestas do espaço de busca. Como chave das raízes, utiliza-se a *string* que representa o vetor característico da raiz. A estrutura de *map* em C++, geralmente implementada com árvores binárias de busca, mantém os elementos ordenados pelo valor de sua chave, portanto as raízes são armazenadas de maneira ordenada lexicograficamente.

A estratégia adotada por Reis na escolha de uma raiz da floresta consiste em escolher de maneira equiprovável o primeiro ou o último elemento do *map* de raízes. Esta estratégia é aleatória e é viesada pois tende a escolher os primeiros ou últimos elementos de uma ordenação. Como esta estratégia de ordenação é arbitrária e não existe aparente fundamentação lógica que a justifique, acreditamos que novas estratégias de escolhas de raízes podem trazer melhores resultados ao algoritmo PFS.

### 3.2.1 Escolha equiprovável

A primeira estratégia que testamos foi uma escolha também aleatória, mas com uma distribuição de probabilidade de escolhas igual para cada raiz da floresta. Como a estratégia de Reis é viesada, julgamos necessário investigar se este viés não leva o algoritmo a fazer ramificações ou podas ruins, que comprometessem o tempo de execução do algoritmo. Se o tempo de execução com a nova estratégia é menor, então confirmamos esta hipótese.

Para implementar esta nova escolha, utilizamos a mesma estrutura de dados utilizada por Reis com uma pequena modificação no código. Seja  $\mathcal{F}$  a floresta de percorrimento escolhida e suponha que existe uma ordenação das raízes dessa floresta,  $\langle r_1, r_2, \dots, r_{|\mathcal{F}|} \rangle$ , então sorteamos um número  $i$  entre 1 e  $|\mathcal{F}|$  e escolhemos a raiz  $r_i$  para o percorrimento.

### 3.2.2 Escolha de maior árvore

A segunda estratégia que testamos para escolha de raízes é determinística e se baseia em escolher a raiz que tem maior sub-árvore. Acreditamos que este critério pode acelerar o algoritmo porque com podas maiores é possível que o algoritmo precise visitar menos nós do reticulado e portanto fazer menos operações, incluindo menos cálculos da função custo.

A sub-árvore completa que tem como raiz o nó  $\mathbf{N}$  é composta pelos nós do intervalo  $[\mathbf{N}[\text{vertex}], \mathbf{N}[\text{vertex}] \cup \mathbf{N}[\text{adjacent}]]$  e portanto, o tamanho da árvore é dado por

$$\begin{aligned} |[\mathbf{N}[\text{vertex}], \mathbf{N}[\text{vertex}] \cup \mathbf{N}[\text{adjacent}]]| &= |\{\mathbf{N}[\text{vertex}] \cup W : W \in \mathcal{P}(\mathbf{N}[\text{adjacent}])\}| \\ &= |\mathcal{P}(\mathbf{N}[\text{adjacent}])| \\ &= |\mathcal{P}(\cup_{i=\mathbf{N}[\text{leftmost}]}^n s_i)| \\ &= 2^{n-\mathbf{N}[\text{leftmost}]} \end{aligned}$$

portanto, basta escolher a raiz com menor valor de `leftmost`. Agora note que, para as raízes da floresta  $\mathcal{F}_A$ , o valor de `leftmost` é igual ao maior índice de uma característica presente no conjunto, enquanto na floresta  $\mathcal{F}_B$  é igual ao maior índice de uma característica não presente no conjunto.

Se ordenamos as raízes de forma lexicográfica da direita para esquerda (da característica com maior índice para característica com menor índice). Então, a menor raiz é aquela que possui mais zeros da direita para esquerda, ou seja, o menor valor para o maior índice de uma característica presente e consequentemente o menor `leftmost` da floresta  $\mathcal{F}_A$ . Já a maior raiz é aquela que possui mais uns da direita para esquerda, ou seja, o menor valor para o maior índice de uma característica não presente e consequentemente o maior `leftmost` da floresta  $\mathcal{F}_B$ .

Portanto, para implementar esta modificação devemos mudar o tipo de ordenação feito pelo *map*, que por padrão é feito lexicograficamente da esquerda para direita (ordem alfabética), e escolher para floresta  $\mathcal{F}_A$  o primeiro elemento do *map* e para a floresta  $\mathcal{F}_B$  o último elemento.

## 3.3 Melhoramentos no controle de raízes

A quantidade de raízes em uma floresta pode ser muito grande no decorrer do algoritmo PFS. Um pior caso, exagerado, é considerar que os percorrimentos foram feitos sempre em uma das florestas e que a função de custo é monótona tal que não houveram podas por conta de aumento de custo; então, esta floresta poderá ter até  $2^n - n + 1$  raízes. Além disso, a estrutura *map* ordena as raízes, o que não é necessário para o funcionamento do algoritmo (exceto para a abordagem que escolhe a raiz com maior sub-árvore).

Introduzimos então o uso de diagramas de decisão binária ordenados (Ordered Binary Decision Diagram (OBDD)). Esta estrutura representa uma função Booleana  $f : \{0, 1\}^k \rightarrow \{0, 1\}$  através de uma árvore. Para se encontrar o valor de um conjunto  $X \in \{0, 1\}^n$ , percorremos esta árvore ramificando de acordo com a presença ou não de uma variável e o valor deve ser encontrado em uma folha da árvore. Em nossa implementação, precisamos modificar estes diagramas. Ao armazenar as raízes, precisamos que este diagrama permita armazenar nós ao



invés de valores Booleanos; além disso, implementamos uma redução que ao encontrar nós redundantes (duas folhas que indicam que o subconjunto não é raiz), condensa-os para apenas um nó. A figura 3.5 mostra um exemplo de OBDD que representa uma floresta do algoritmo PFS.

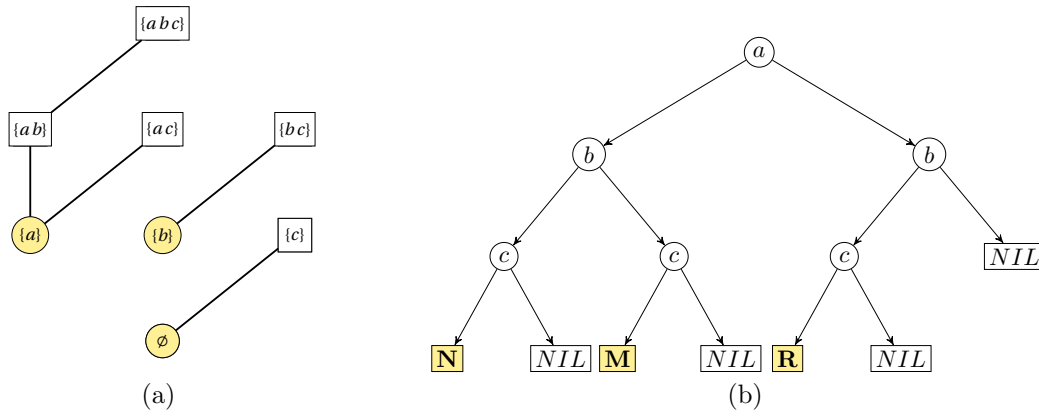


Figura 3.5: Exemplo de OBDD que representa uma floresta do PFS. Esta OBDD contém os nós **N**, **M** e **R**, que representam respectivamente os subconjuntos 000, 010 e 100. As folhas *NIL* indicam que os subconjuntos de tal caminho na OBDD não são raízes na floresta, como por exemplo os subconjuntos 11X

Para escolha das raízes, nesta estrutura de dados usamos a estratégia de escolha aleatória com probabilidades igualmente distribuídas.

### 3.3.1 Testes com instâncias artificiais

## 3.4 Paralelização do código

A dinâmica do algoritmo *Poset-Forest-Search* transforma o reticulado Booleano em uma floresta, ou seja, em um conjunto de árvores que são disjuntas. Por isso, o percorrimto destas árvores pode ser feito de maneira paralela sem interferências. Desta maneira, propomos uma paralelização do código de Reis utilizando a biblioteca *OpenMP*, que nos permite paralelizar blocos de instrução com anotações feitas ao compilador.

O primeiro ponto que devemos nos atentar ao paralelizar este código é que as árvores do espaço de busca são disjuntas apenas se estamos considerando uma floresta. Ambas florestas representam o mesmo espaço de busca, portanto é possível que duas árvores de florestas diferentes se intersectem em alguns nós. Isto significa que fazer o percorrimto em ambas as direções pode causar recálculos, isto é, um nó pode ser visitado desnecessariamente por mais de uma thread por mais de uma vez; além disso, é possível que uma árvore que foi podada em uma direção ainda esteja sendo percorrida em outra direção.

Visando simplificar o trabalho, definimos que a paralelização ocorre em iterações do procedimento principal do PFS. Isto é, a escolha de uma direção deve ser feita por uma thread principal e, assim cada thread deve escolher uma raiz para ser percorrida em tal direção. Desta maneira cada thread faz a ramificação e atualização da floresta dual e pausam em uma barreira, que sincroniza todas as threads para o finalização da iteração e começo da próxima.

Entretanto, apesar desta simplificação tornar a fase de ramificação quase independente entre as linhas de processamento, a fase de atualização de floresta dual pode não ser. Como resultado, condições de corrida não tratadas podem causar inconsistências na atualização da floresta.

## **3.5 O algoritmo UBB-PFS**

# Capítulo 4

## O algoritmo Parallel U-Curve Search

O algoritmo **Parallel U-Curve Search** (PUCS) foi desenvolvido para resolver o problema U-Curve particionando o espaço de busca em partes que podem ser resolvidas independentemente e de forma paralela. Além disso, a dinâmica desse algoritmo depende de parâmetros que determinam o tempo de execução e qualidade da solução obtida, permitindo ao usuário adequar o algoritmo aos recursos computacionais disponíveis.

### 4.1 Princípios

Seja  $S$  o conjunto de características do problema em questão. O primeiro passo do particionamento é escolher arbitrariamente  $S'$  um subconjunto de  $S$ ; de maneira complementar, definimos  $\overline{S'} = S \setminus S'$ . Agora, sejam  $X, Y \in \mathcal{P}(S)$  e  $\sim$  a relação:

$$X \sim Y \iff (X \cap S') = (Y \cap S')$$

Esta relação é de equivalência, pois nela valem:

- reflexividade

$$X \sim X, \text{ pois } (X \cap S') = (X \cap S')$$

- simetria

$$\begin{aligned} X \sim Y &\iff \\ (X \cap S') = (Y \cap S') &\iff \\ (Y \cap S') = (X \cap S') &\iff \\ Y \sim X & \end{aligned}$$

- transitividade,

$$\begin{aligned} X \sim Y, Y \sim Z &\Rightarrow \\ (X \cap S') = (Y \cap S') = (Z \cap S') &\Rightarrow \\ (X \cap S') = (Z \cap S') &\Rightarrow \\ X \sim Z & \end{aligned}$$

Portanto, o conjunto das classes de equivalência definidas por  $\sim$  é uma partição do espaço de busca original. Tome como exemplo o conjunto  $S = \{a, b, c\}$ ; se  $S' = a$ , então existem duas classes de equivalência no particionamento do espaço de busca que definimos, formados pelos conjuntos  $\{\emptyset, b, c, bc\}$  e  $\{a, ab, ac, abc\}$ .

Pela definição da relação  $\sim$  temos que a presença de cada característica de  $S'$  em uma dada parte do reticulado não muda, isto é, ou ela está presente em todos subconjuntos da parte ou não está presente em nenhum, portanto, dizemos que estas variáveis são **fixas**. De modo análogo, as variáveis de  $\overline{S'}$  são **livres**. Tanto variáveis fixas quanto livres podem definir reticulados Booleanos junto a relação de ordem parcial  $\subseteq$ .

O conjunto  $\mathcal{P}(S')$  induz um reticulado Booleano em que cada elemento representa uma classe de equivalência do espaço de soluções do problema original, chamamos este de **reticulado externo**. Para cada classe de equivalência (nó do reticulado externo), o conjunto  $\mathcal{P}(\overline{S'})$  induz um outro reticulado Booleano (**reticulado interno**) em que cada elemento representa um subconjunto de problema original. Seja  $A \in \mathcal{P}(S')$  um elemento do reticulado externo, então cada  $B \in \mathcal{P}(\overline{S'})$  do reticulado interno em  $A$  representa o conjunto  $X = B \cup A$  do espaço de busca do problema original. A figura 4.1 apresenta um exemplo de particionamento feito pelo PUCS em um reticulado Booleano com cinco características.

Os reticulados internos e externo elucidam a estrutura recursiva do problema de seleção de características e sugerem que podemos construir uma solução ao problema original a partir de soluções de outros problemas, sobre os reticulados externo e internos, abordagem conhecida em computação como divisão e conquista. Seja  $\langle S, c \rangle$  uma instância do problema de seleção de características,  $S'$  o conjunto de variáveis fixas,  $\overline{S'}$  o conjunto de variáveis livres, e  $A \in \mathcal{P}(S')$  um subconjunto que é nó do reticulado externo, então podemos definir um outro problema de seleção de características  $\langle \overline{S'}, c_A \rangle$  em que

$$c_A(X) = c(X \cup A).$$

Resolver a instância  $\langle \overline{S'}, c_A \rangle$  é essencialmente achar o mínimo do problema inicial restrito a classe de equivalência de  $A$ , dizemos também que estamos resolvendo a parte  $A$ . Se soubermos em qual classe o mínimo global reside, podemos resolver apenas tal parte e garantir que a solução encontrada é a solução do problema original.

## 4.2 Dinâmica

Com as estruturas de reticulado interno e externo, o PUCS resolve uma instância do problema U-Curve em duas etapas. Na primeira, o algoritmo percorre o reticulado externo, fazendo podas sempre que possível, e armazena cada parte que é candidata a conter o mínimo global do problema. Na segunda etapa, para cada parte candidata, resolve-se o problema U-Curve auxiliar que é equivalente ao problema original, mas restrito a parte de interesse; em seguida, escolhe-se como resposta o conjunto custo mínimo entre as soluções dos problemas parciais.

### 4.2.1 Condições de poda

As podas eliminam do reticulado externo intervalos da forma  $[X, \mathcal{P}(S')]$  ou  $[\emptyset, X]$  e são realizadas sempre que a hipótese de curva em U implica que todas as partes contidas nestes intervalos não contém o mínimo global. Para entender o critério de poda, vamos definir que a **ponta superior** de um reticulado Booleano  $\mathcal{P}(A)$  é o próprio conjunto  $A$  e a **ponta inferior** deste reticulado é o conjunto vazio. Note que no reticulado interno de uma parte  $P$  a ponta inferior

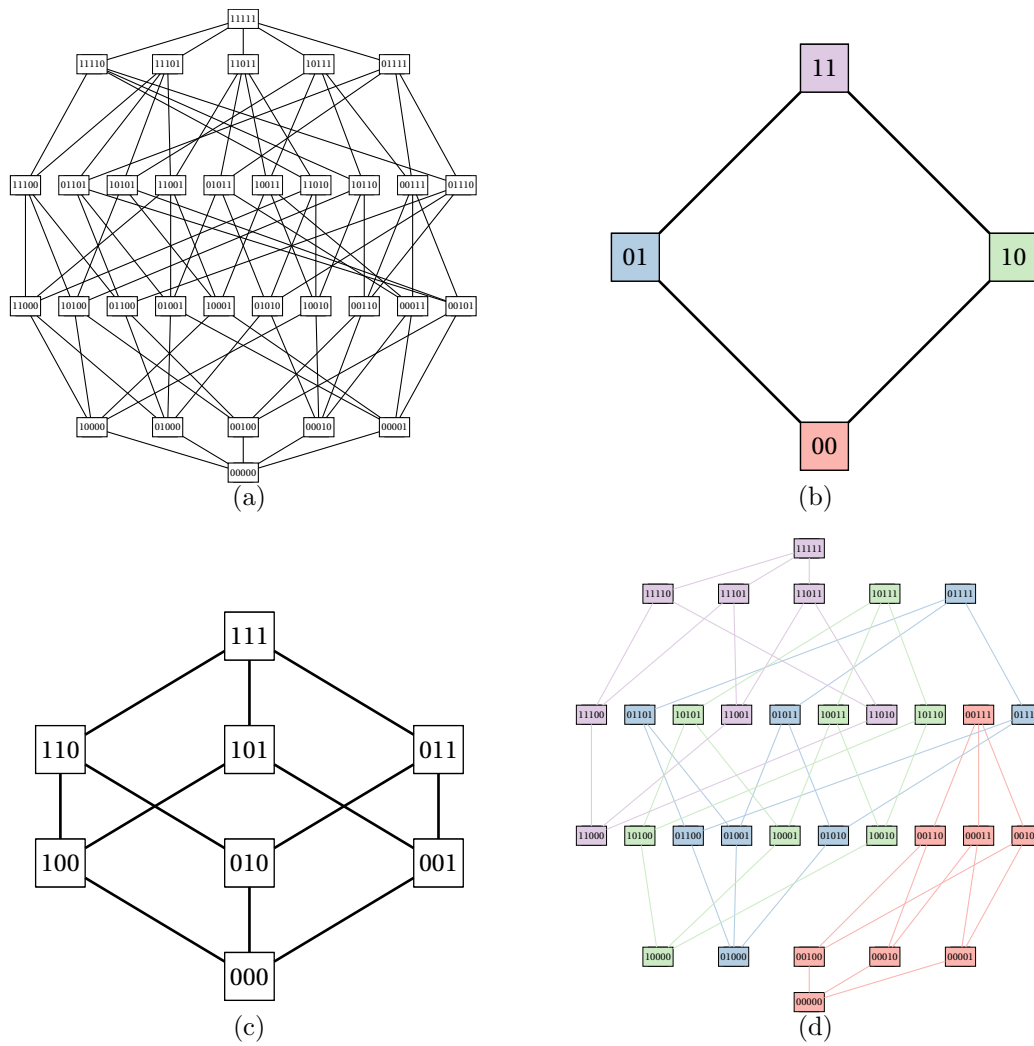


Figura 4.1: Exemplo de particionamento feito pelo algoritmo PUCS em uma instância com cinco características; o reticulado Booleano desta instância é representado na figura 4.1(a). Neste particionamento, as duas primeiras variáveis formam o conjunto de variáveis fixadas, definindo o reticulado externo (figura 4.1(b)) enquanto as outras três definem os reticulados internos, que são cópias do reticulado da figura 4.1(c). A figura 4.1(d) mostra o reticulado Booleano original, sem as arestas que ligam duas partes diferentes, e a cor de cada nó representa a qual parte tal nó pertence, de acordo com as cores do reticulado externo em 4.1(b) Note que, de fato, cada parte forma um reticulado pequeno de mesmo tamanho e com mesma estrutura que o reticulado da figura 4.1(c)

representa o próprio conjunto de características  $P$ , enquanto que a ponta superior representa o conjunto de características  $P \cup \overline{S'}$ .

**Teorema 4.2.1** (Critério de poda para o reticulado externo do algoritmo PUCS). *Sejam  $S$  um conjunto de características e  $S'$  um conjunto de variáveis fixas no particionamento definido pelo algoritmo PUCS. Dados  $P, Q \in \mathcal{P}(S')$  dois elementos do reticulado externo com  $Q \subseteq P$ ; se a ponta inferior do reticulado interno de  $P$  tem custo maior do que a ponta inferior do reticulado interno de  $Q$ , então todas as partes do intervalo  $[P, \mathcal{P}(S')]$  tem apenas conjuntos de características com custo maior do que o custo da ponta inferior de  $Q$ .*

*Demonstração.* Se o custo da ponta inferior do reticulado interno de  $P$  é maior do que a de  $Q$ , então:

$$\begin{aligned}
c_Q(\emptyset) &< c_P(\emptyset) \\
c(\emptyset \cup Q) &< c(\emptyset \cup P) \\
c(Q) &< c(P)
\end{aligned}$$

Como  $Q \subseteq P$ , temos que existe uma cadeia que passa pelas pontas inferiores de  $Q$  e  $P$ . Além disso, para qualquer conjunto de características  $X \in \mathcal{P}(S)$ , com  $P \subseteq X$ , a hipótese de curva em U garante que:

$$c(P) \leq \max\{c(Q), c(X)\}$$

e como  $c(P) > c(Q)$ , temos que  $c(X) \geq c(P)$ , isto é, qualquer elemento do reticulado Booleano original que cobre a ponta inferior de  $P$  tem custo estritamente maior do que o custo da ponta inferior de  $Q$ . Note que para qualquer parte  $R$  do intervalo  $[P, \mathcal{P}(S')]$ , vale que  $P \subseteq R$ , e como a ponta inferior de  $P$  não contém nenhum elemento de  $\overline{S'}$ , então qualquer conjunto de características da parte  $R$  cobre a ponta inferior de  $P$  e portanto tem custo estritamente maior do que o custo da ponta inferior da parte  $Q$ .  $\square$

**Teorema 4.2.2** (Critério dual de poda para o reticulado externo do algoritmo PUCS). *Sejam  $S$  um conjunto de características e  $S'$  um conjunto de variáveis fixas no particionamento definido pelo algoritmo PUCS. Dados  $P, Q \in \mathcal{P}(S')$  dois elementos do reticulado externo com  $Q \subseteq P$ ; se a ponta superior do reticulado interno de  $P$  tem custo menor do que a ponta superior do reticulado interno de  $Q$ , então todas as partes do intervalo  $[\emptyset, Q]$  tem apenas conjuntos de características com custo maior do que o custo da ponta superior de  $P$ .*

*Demonstração.* Se o custo da ponta superior do reticulado interno de  $Q$  é maior do que a de  $P$ , então:

$$\begin{aligned}
c_P(\overline{S'}) &< c_Q(\overline{S'}) \\
c(\overline{S'} \cup P) &< c(\overline{S'} \cup Q)
\end{aligned}$$

Como  $Q \subseteq P$ , temos que existe uma cadeia que passa pelas pontas superiores de  $Q$  e  $P$ . Além disso, para qualquer conjunto de características  $X \in \mathcal{P}(S)$ , com  $\{Q \cup \overline{S'}\} \supseteq X$ , a hipótese de curva em U garante que:

$$c(Q \cup \overline{S'}) \leq \max\{c(P \cup \overline{S'}), c(X)\}$$

e como  $c(Q \cup \overline{S'}) > c(P \cup \overline{S'})$ , temos que  $c(X) \geq c(Q \cup \overline{S'})$ , isto é, qualquer elemento do reticulado Booleano original que é coberto pela ponta superior de  $Q$  tem custo estritamente maior do que o custo da ponta superior de  $P$ . Note que para qualquer parte  $R$  do intervalo  $[\emptyset, Q]$ , vale que  $R \subseteq Q$ , e como a ponta superior de  $Q$  contém todos os elementos de  $\overline{S'}$ , então qualquer conjunto de características da parte  $R$  é coberto pela ponta superior de  $Q$  e portanto tem custo estritamente maior do que o custo da ponta superior da parte  $P$ .  $\square$

### 4.2.2 Passeio aleatório no reticulado externo

O passeio do PUCS se inicia escolhendo arbitrariamente um nó inicial que pertence ao espaço de busca, então a cada passo escolhe-se aleatoriamente um vizinho do nó corrente, que também deve pertencer ao espaço de busca, e verificam-se as condições de poda. Caso elas sejam verdadeiras, o procedimento de poda elimina parte do reticulado; se o vizinho escolhido foi removido nesta etapa, então escolhe-se outro vizinho. O vizinho escolhido torna-se então o nó corrente e o procedimento é repetido até que não seja possível escolher um vizinho; quando isto ocorre e o espaço ainda não foi esgotado, escolhe-se novamente um início de passeio arbitrariamente. Todo nó visitado é automaticamente removido do espaço de busca, e os passeios aleatórios são repetidos até que o espaço de busca tenha sido esgotado, ou seja, todo nó foi ou visitado ou removido em alguma poda.

Durante a realização dos passeios aleatórios, precisamos armazenar quais são as partes candidatas a conterem o mínimo global. As podas deste algoritmo removem do espaço de busca apenas partes que obrigatoriamente não contém o mínimo global, portanto qualquer outra parte é candidata a conter tal elemento. Desta forma, como toda parte é visitada ou podada, temos que o conjunto de nós visitados e não podados é exatamente o conjunto de candidatos a conterem o subconjunto de custo ótimo.

As figuras 4.2 - 4.4 mostram a dinâmica do PUCS ao resolver uma instância do problema U-Curve.

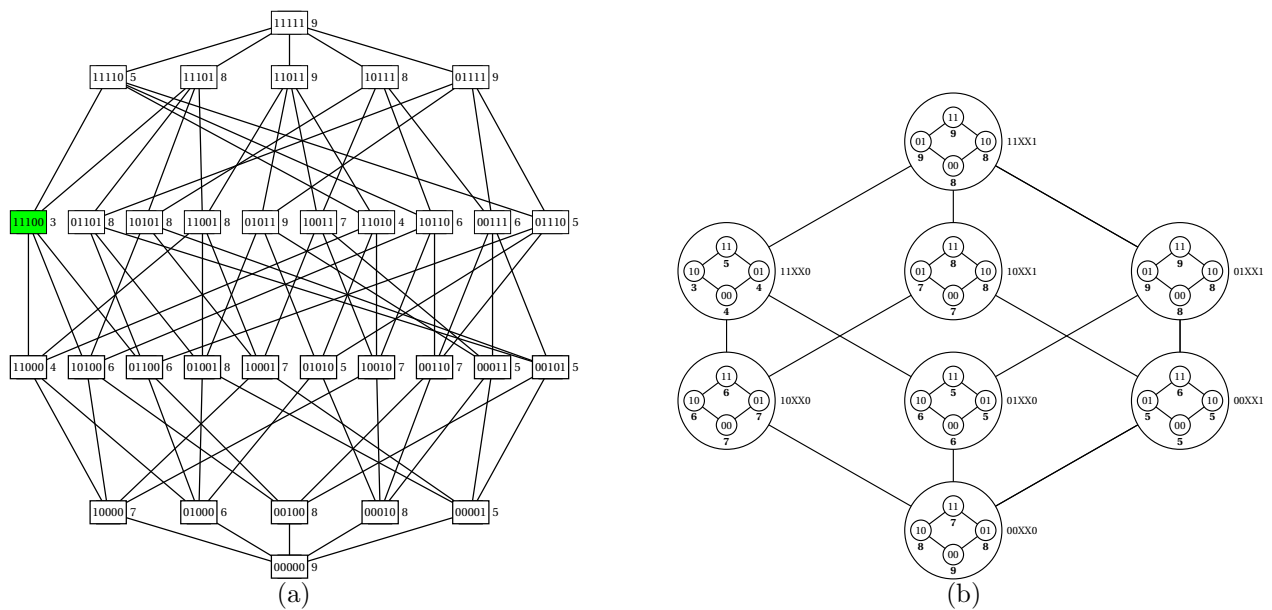


Figura 4.2: Uma instância do problema U-Curve e o seu particionamento quando o conjunto de variáveis fixas  $S'$  é composto pela primeira, segunda e última variável. No reticulado externo, denotamos por  $X$  don't cares, que são as variáveis livres do particionamento. O subconjunto colorido em verde é o elemento de custo mínimo desta instância.

- Figura 4.2(a): uma instância do problema U-Curve com cinco características e com a função de custo anotada ao lado dos nós do reticulado.
- Figura 4.2(b): o particionamento do espaço de busca quando são fixadas a primeira, segunda e última característica.

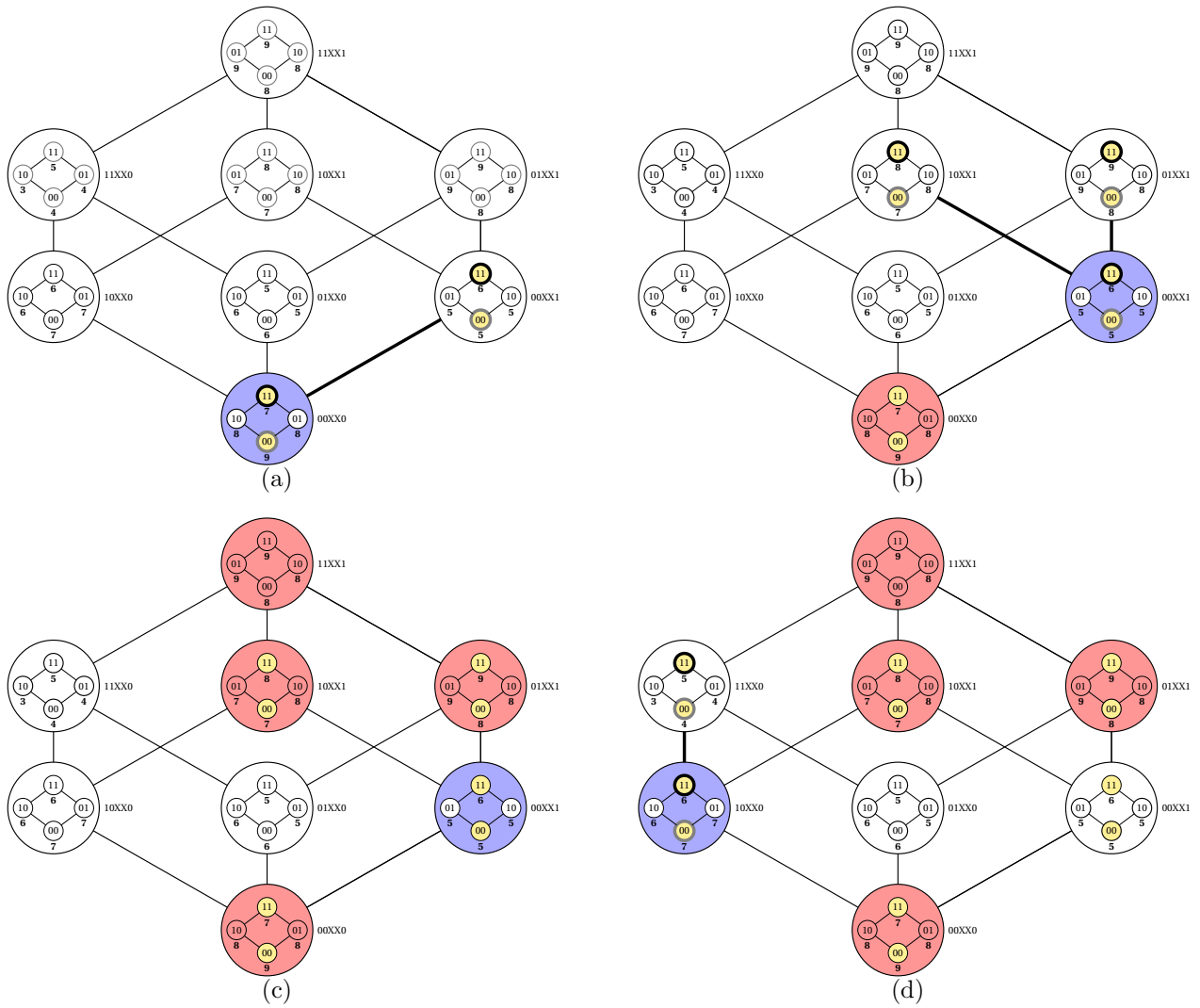


Figura 4.3: Dinâmica do algoritmo PUCS ao resolver a instância apresentada na figura 4.2

- Figura 4.3(a) a parte 00XX0 é escolhida arbitrariamente para ser o início do passeio aleatório. O vizinho 00XX1 é escolhido aleatoriamente como candidato a ser o próximo nó do passeio. Como o custo da ponta superior de 00XX1 (6) é menor do que o custo da ponta superior de 00XX0 (7), o intervalo de partes  $[000, 000]$  é removido do espaço de busca.
- Figura 4.3(b) as pontas inferiores das partes 10XX1 (7) e 01XX1 (8) têm custo maior do que a ponta inferior de 00XX1 (5), portanto os intervalos de partes  $[101, 111]$  e  $[011, 111]$  são removidos do espaço de busca.
- Figura 4.3(c) todos os vizinhos de 00XX1 foram podados, portanto esta parte torna-se candidata a conter o mínimo, e iniciamos um novo passeio.
- Figura 4.3(d) a parte 10XX0 é escolhida arbitrariamente como início de passeio. O custo da ponta superior de 10XX0 (6) é maior do que o custo da ponta superior de 11XX0 (5), portanto o intervalo de partes  $[000, 100]$  é removido do espaço de busca.



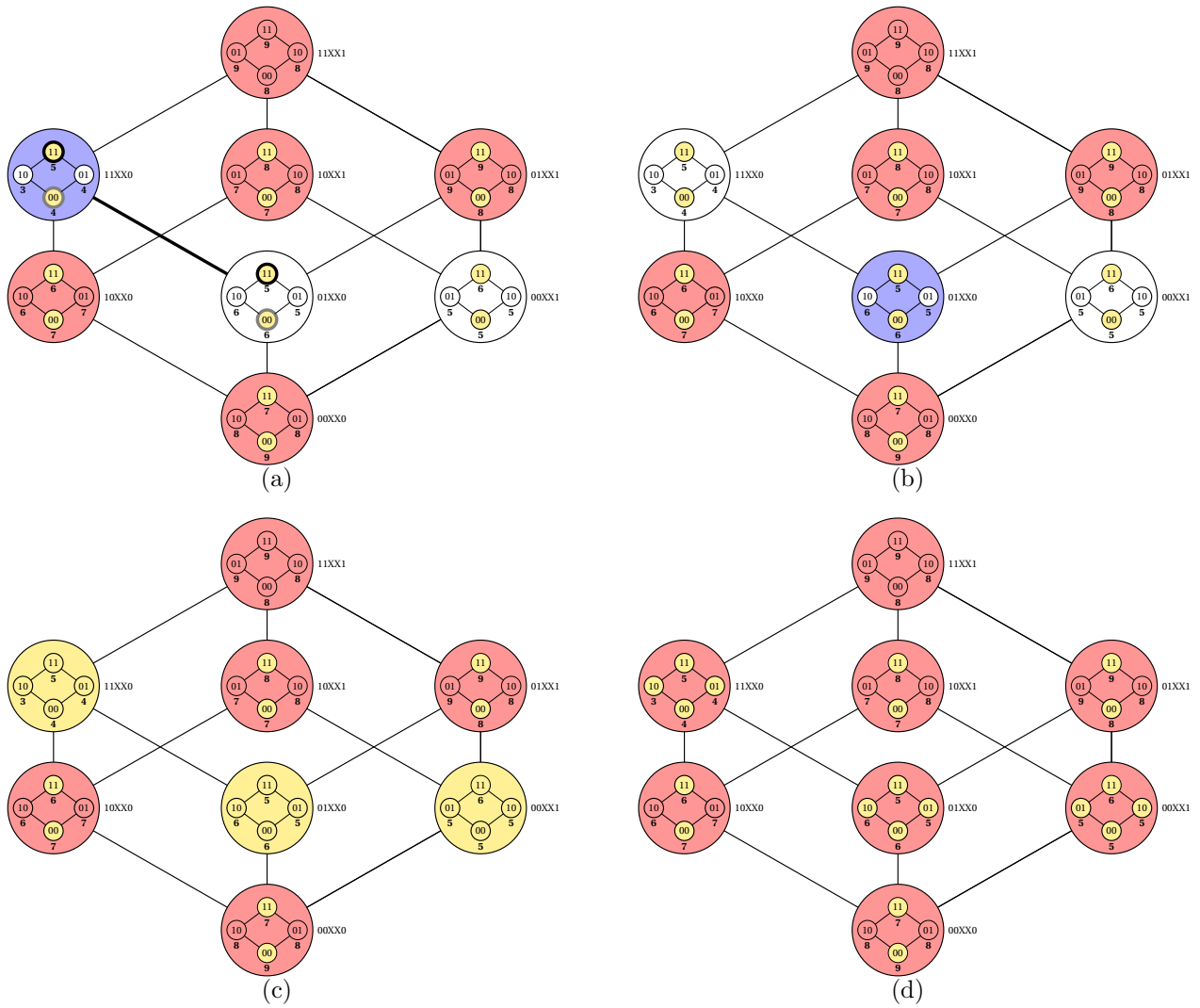


Figura 4.4: Continuação da figura 4.3

- Figura 4.4(a) Nenhuma poda é realizada ao comparar 11XX0 com 01XX0, portanto a última torna-se o nó corrente e a primeira torna-se candidata a conter o mínimo.
- Figura 4.4(b) A parte 01XX0 torna-se o nó corrente, mas como não possui vizinho no espaço de busca é removida do espaço de busca e torna-se candidata a conter o mínimo.
- Figura 4.4(c) Todo nó foi removido do espaço de busca por podas ou por visitas. Resolve-se as partes candidatas a conter o mínimo.
- Figura 4.4(d) O elemento de custo mínimo entre as partes é 11100, que é de fato a solução ótima do problema com custo 3.

### 4.2.3 Solução das partes

Ao fim do passeio aleatório, teremos uma coleção de partes que precisam ser resolvidas para se obter o conjunto de custo mínimo. Nesta etapa, o PUCS constrói para cada parte uma instância auxiliar do problema U-Curve que é equivalente ao problema original, porém restrito

a parte de interesse. Seja  $\langle S, c \rangle$  a instância do problema original e  $S'$  o conjunto de variáveis fixas no particionamento feito pelo PUCS neste problema, então, dada uma parte  $A \in \mathcal{P}(S')$ , o conjunto de custo mínimo nesta parte é exatamente a solução ótima do problema U-Curve auxiliar  $\langle \overline{S'}, c_A \rangle$  em que  $c_A(X) = c(X \cup A)$  para qualquer  $X \in \mathcal{P}(\overline{S'})$ .

Para solucionar os problemas auxiliares, podemos chamar um outro algoritmo de seleção de características, ótimo ou sub-ótimo, e podemos inclusive chamar o próprio PUCS, tornando o algoritmo recursivo. Chamamos o último algoritmo na sequência de chamadas recursivas de **algoritmo base**; o PUCS é algoritmo base apenas no caso em que cada parte contém apenas um elemento. A escolha do algoritmo base é crítica no desempenho da chamada do PUCS no que diz respeito a uso de recursos computacionais e também na qualidade da solução obtida.

### 4.3 Parâmetros de funcionamento

Na seção anterior apresentamos a dinâmica básica do algoritmo PUCS, porém por simplicidade não definimos alguns parâmetros que regem o funcionamento do mesmo. Apesar de ser fácil entender a dinâmica do algoritmo sem conhecer estes parâmetros, eles tem papel crítico no desempenho do mesmo, tanto no quesito de uso de recursos computacionais quanto na qualidade da solução encontrada. Estes parâmetros são  $p$ ,  $l$ , e algoritmo base.

O parâmetro  $p$  define a quantidade de variáveis fixas no particionamento do espaço de busca e deve estar contido no intervalo  $(0, 1]$ , sendo a proporção de variáveis que devem ser fixadas; desta forma:

$$\begin{aligned} |S'| &= \lceil |S| * p \rceil \\ |\overline{S'}| &= |S| - \lceil |S| * p \rceil \end{aligned}$$

Portanto, quanto maior o  $p$ , maior o tamanho do reticulado externo ( $|\mathcal{P}(S')|$ ) e menor o tamanho dos reticulados internos ( $|\mathcal{P}(\overline{S'})|$ ) e vice-versa. Note que quando  $p$  é pequeno o algoritmo PUCS deve ser semelhante ao algoritmo base, já que o tamanho das partes continua semelhante; quando o  $p$  é grande, o particionamento é mais “fino” porque as partes se tornam menores e consequentemente há mais partes.

Como vimos na seção 4.2.3, a estrutura criada no particionamento do problema nos permite fazer chamadas recursivas do PUCS. O parâmetro  $l$  determina a quantidade de chamadas recursivas que acontecerão até que o algoritmo base seja chamado. Ao fazer chamadas recursivas estamos particionando o espaço de busca seguidas vezes e portanto, assim como o parâmetro  $p$ , quando aumentamos o valor de  $l$ , o tamanho da parte que será resolvida pelo algoritmo base diminui.

O algoritmo base determina como as partes serão resolvidas. Note que os teoremas 4.2.1 e 4.2.2 garantem que se a hipótese U-Curve for verdadeira, então todas as partes que foram podadas do espaço de busca não contém o mínimo global, portanto se o algoritmo base é ótimo, então o PUCS também é ótimo. Se o algoritmo base for uma heurística, então o PUCS também se comporta como uma heurística, entretanto é provável que a solução encontrada pelo PUCS seja melhor do que a solução dada pelo algoritmo base. Dizemos que isto é provável porque o PUCS faz diversas chamadas ao algoritmo base, uma para cada parte candidata, portanto percorre mais nós do que uma chamada única do algoritmo base.

## 4.4 Implementação do algoritmo

O algoritmo PUCS foi implementado no arcabouço *featsel*, usando a linguagem C++. Nesta seção apresentaremos detalhes sobre sua implementação

### 4.4.1 Controle do espaço de busca

Sempre que um nó do reticulado externo é podado ou visitado ele deve ser removido do espaço de busca, e representar este espaço explicitamente não é uma boa solução devido ao seu tamanho, que é exponencial em relação a quantidade de características fixas. A estrutura de dados utilizada deve ser eficiente tanto para inserções (de intervalos e de pontos do reticulado) quanto para consultas. Escolhemos para nossa implementação usar a estrutura de dados de diagramas de decisão binária reduzidos e ordenados (*Reduced Ordered Binary Decision Diagram* (ROBDD)) [Bry86].

### 4.4.2 Paralelização do código

Usamos a biblioteca *OpenMP* na paralelização do código. Esta biblioteca nos permite paralelizar o algoritmo de maneira fácil, com anotações que indicam ao compilador como blocos do código fonte podem ser processados paralelamente.

O PUCS foi criado com o intuito de ser um algoritmo paralelo para resolver o problema U-Curve. A particionamento do espaço foi feito exatamente para que o processo de paralelização do código fosse simples, facilitando a distribuição de trabalho entre threads e usando o mínimo de comunicação entre as mesmas. Desta forma, para paralelizar o código, basta indicar ao compilador que o particionamento e passeio pelo reticulado deve ser feito pela thread principal enquanto a solução de cada parte pode ser realizada por qualquer outra thread, usando a estrutura de *tasks* da biblioteca *OpenMP*. Desta forma, sempre que o algoritmo visita uma parte que não é podada, cria-se uma *task* que deve solucionar tal parte.

Esta abordagem pode causar cálculos supérfluos, pois partes resolvidas podem ser podadas no decorrer dos passeios aleatórios, no entanto, para evitar tais recálculos seria necessário esperar o percorrimto de todo reticulado externo antes de se resolver as partes. Esta segunda abordagem tornaria necessário armazenar e manter atualizada uma lista de partes candidatas, o que pode ser caro computacionalmente; além disso, como o passeio é feito apenas por uma thread, todas as outras seriam subutilizadas durante o passeio.

## 4.5 Testes com instâncias artificiais

Nesta seção apresentamos testes feitos com o PUCS ao solucionar instâncias artificiais do problema U-Curve onde função de custo utilizada é a de soma de subconjuntos. Estes testes foram feitos em uma servidora

### 4.5.1 Ajuste de parâmetros

Antes de discutir o desempenho do algoritmo, precisamos entender como os parâmetros devem ser ajustados para cada tipo de instância do problema U-Curve. Consideramos instâncias pequenas aquelas que podem ser resolvidas otimamente. Estas instâncias costumam ter no máximo por volta de 30 características e algoritmos ingênuos como a busca exaustiva podem, já para estas instâncias, se tornar muito caros computacionalmente. Já as instâncias grandes, que

não podem ser resolvidas por algoritmos ótimos, costumam ter mais do que 30 características; utilizam-se para estas algoritmos sub-ótimos, heurísticas.

**Instâncias pequenas**

**Instâncias grandes**

## Capítulo 5

## Conclusão

# Bibliografia

- [AG+18] Esmaeil Atashpaz-Gargari, Marcelo S. Reis, Ulisses M. Braga-Neto, Junior Barrera e Edward R. Dougherty. «A fast Branch-and-Bound algorithm for U-curve feature selection». Em: *Pattern Recognition* 73.Supplement C (2018), pp. 172 –188. ISSN: 0031-3203. DOI: <https://doi.org/10.1016/j.patcog.2017.08.013>. URL: <http://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S0031320317303254>.
- [Bar+07] J. Barrera, R. M. Cesar-Jr, D.C. Martins-Jr, R.Z.N Vencio, E. F. Merino, M. M. Yamamoto, F. G. Leonardi, C. A. B. Pereira e H. A. Portillo. «Constructing probabilistic genetic networks of *Plasmodium falciparum* from dynamical expression signals of the intraerythrocytic development cycle.» Em: *Methods of Microarray Data Analysis V* (2007), pp. 11–26.
- [Bry86] R. E. Bryant. «Graph-Based Algorithms for Boolean Function Manipulation». Em: *IEEE Transactions on Computers* C-35.8 (1986), pp. 677–691. ISSN: 0018-9340. DOI: 10.1109/TC.1986.1676819.
- [DMJ06] R.M. Cesar-Jr an J. Barrera D.C. Martins-Jr. «W-operator window design by minimization of mean conditional entropy». Em: *Patter Analysis & Applications* (2006), pp. 139–153.
- [JCJB04] D. C. Martins Jr, R. M. Cesar-Jr e J. Barrera. «W-operator window design by maximization of training data information». Em: *Computer Graphics and Image Processing, 2004. Proceedings. 17th Brazilian Symposium* (2004), pp. 162–169.
- [Rei+17] Marcelo S. Reis, Gustavo Estrela, Carlos Eduardo Ferreira e Junior Barrera. «feat-sel: A framework for benchmarking of feature selection algorithms and cost functions». Em: *SoftwareX* 6 (2017), pp. 193 –197. ISSN: 2352-7110. DOI: <https://doi.org/10.1016/j.softx.2017.07.005>. URL: <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S2352711017300286>.
- [RFB14] M. S. Reis, C. E. Ferreira e J. Barrera. «The U-curve optimization problem: improvements on the original algorithm and time complexity analysis». Em: *ArXiv e-prints* (jul. de 2014). arXiv: 1407.6067 [cs.LG].
- [Rei12] M. S. Reis. «Minimization of decomposable in U-shaped curves functions defined on poset chains – algorithms and applications». Tese de doutoramento. University of Sao Paulo, 2012.