实验课程名称：\_《数学软件与数学实验》\_

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **实验项目名称** | **实验六.应用matlab优化工具箱解决问题** | | | **实验成绩** |  |
| **实 验 者** | **赵骁勇** | **专业班级** | **数学类1703** | **组 别** |  |
| **同 组 者** |  | | | **实验日期** | **2018 年 ５月 １０ 日** |
| **实验6（选作）应用Matlab优化工具箱解决优化问题**  **1.MATLAB求解优化问题的主要函数**  **2.优化函数的输入变量**  使用优化函数或优化工具箱中其它优化函数时, 输入变量见下表:  **3. 优化函数的输出变量下表:**  **4．控制参数options的设置**  **Options中常用的几个参数的名称、含义、取值如下:**  (1) **Display**: 显示水平.取值为’off’时,不显示输出; 取值为’iter’时,显示每次迭代的信息;取值为’final’时,显示最终结果.默认值为’final’.  (2) **MaxFunEvals**: 允许进行函数评价的最大次数,取值为正整数.  (3) **MaxIter**: 允许进行迭代的最大次数,取值为正整数  **控制参数options可以通过函数optimset创建或修改。命令的格式如下：**  (1) **options=optimset(‘optimfun’)**  创建一个含有所有参数名,并与优化函数optimfun相关的默认值的选项结构options.  （2）**options=optimset(‘param1’,value1,’param2’,value2,...)**  创建一个名称为options的优化选项参数,其中指定的参数具有指定值,所有未指定的参数取默认值.  (3)**options=optimset(oldops,‘param1’,value1,’param2’,**  **value2,...)**  创建名称为oldops的参数的拷贝,用指定的参数值修改oldops中相应的参数.  例：opts=optimset(‘Display’,’iter’,’TolFun’,1e-8)  该语句创建一个称为opts的优化选项结构,其中显示参数设为’iter’, TolFun参数设为1e-8.  **用Matlab解无约束优化问题**  **一元函数无约束优化问题**  **常用格式如下：**  （1）**x= fminbnd (*fun,x1,x2*)**  （2）**x= fminbnd (*fun,x1,x2* ，options)**  （3）**[x，fval]= fminbnd（...）**  （4）**[x，fval，exitflag]= fminbnd（...）**  （5）**[x，fval，exitflag，output]= fminbnd（...）**  其中（3）、（4）、（5）的等式右边可选用（1）或（2）的等式右边。  函数fminbnd的算法基于黄金分割法和二次插值法，它要求目标函数必须是连续函数，并可能只给出局部最优解。  **例1 求**在0<x<8中的最小值与最大值  **主程序为wliti1.m:**  f='2\*exp(-x).\*sin(x)';  fplot(f,[0,8]); %作图语句  [xmin,ymin]=fminbnd (f, 0,8)  f1='-2\*exp(-x).\*sin(x)';  [xmax,ymax]=fminbnd (f1, 0,8)  运行结果：  xmin = 3.9270 ymin = -0.0279  xmax = 0.7854 ymax = 0.6448  **例2** 对边长为3米的正方形铁板，在四个角剪去相等的正方形以制成方形无盖水槽，问如何剪法使水槽的容积最大？  **解**  **先编写M文件fun0.m如下:**  function f=fun0(x)  f=-(3-2\*x).^2\*x;  **主程序为wliti2.m:**  [x,fval]=fminbnd('fun0',0,1.5);  xmax=x  fmax=-fval  **运算结果为:** xmax = 0.5000,fmax =2.0000.即剪掉的正方形的边长为0.5米时水槽的容积最大,最大容积为2立方米.  **2、多元函数无约束优化问题**  **标准型为**：*min F(X)*  **命令格式为:**  *（1）*x= fminunc（*fun,X0* ）；或x=fminsearch（*fun,X0* ）  *（2）*x= fminunc（*fun,X0* ，options）；  或x=fminsearch（*fun,X0* ，options）  *（3）*[x，fval]= fminunc（...）；  或[x，fval]= fminsearch（...）  *（4）*[x，fval，exitflag]= fminunc（...）；  或[x，fval，exitflag]= fminsearch  *（5）*[x，fval，exitflag，output]= fminunc（...）；  或[x，fval，exitflag，output]= fminsearch（...）  **说明:**   * **fminsearch是用单纯形法寻优. fminunc的算法见以下几点说明：**   [1] fminunc为无约束优化提供了大型优化和中型优化算法。由options中的参数LargeScale控制：  LargeScale=’on’(默认值),使用大型算法  LargeScale=’off’(默认值),使用中型算法  [2] fminunc为中型优化算法的搜索方向提供了4种算法，由  options中的参数HessUpdate控制：  HessUpdate=’bfgs’（默认值），拟牛顿法的BFGS公式；  HessUpdate=’dfp’，拟牛顿法的DFP公式；  HessUpdate=’steepdesc’，最速下降法  [3] fminunc为中型优化算法的步长一维搜索提供了两种算法，  由options中参数LineSearchType控制：  LineSearchType=’quadcubic’(缺省值)，混合的二次和三  次多项式插值；  LineSearchType=’cubicpoly’，三次多项式插   * **使用fminunc和 fminsearch可能会得到局部最优解.**   **例3** min f(x)=(4x12+2x22+4x1x2+2x2+1)\*exp(x1)  **1、编写M-文件 fun1.m:**  function f = fun1 (x)  f = exp(x(1))\*(4\*x(1)^2+2\*x(2)^2+4\*x(1)\*x(2)+2\*x(2)+1);    **2、输入M文件wliti3.m如下:**  x0 = [-1, 1];  x=fminunc(‘fun1’,x0);  y=fun1(x)  **3、运行结果:**  x= 0.5000 -1.0000  y = 1.3029e-10   1. Rosenbrock 函数 f（x1，x2）=100（x2-x12）2+(1-x1)2   的最优解（极小）为x\*=（1，1），极小值为f\*=0.试用  不同算法（搜索方向和步长搜索）求数值最优解.  初值选为x0=（-1.2 , 2）.   1. **为获得直观认识，先画出Rosenbrock 函数的三维图形**,   输入以下命令：  [x,y]=meshgrid(-2:0.1:2,-1:0.1:3);  z=100\*(y-x.^2).^2+(1-x).^2;  mesh(x,y,z)  2. **画出Rosenbrock 函数的等高线图,**输入命令：  contour(x,y,z,20)  hold on  plot(-1.2,2,' o ');  text(-1.2,2,'start point')  plot(1,1,'o')  text(1,1,'solution')  **3.用fminsearch函数求解**  输入命令:  f='100\*(x(2)-x(1)^2)^2+(1-x(1))^2';  [x,fval,exitflag,output]=fminsearch(f, [-1.2 2])  运行结果:  x =1.0000 1.0000  fval =1.9151e-010  exitflag = 1  output =  iterations: 108  funcCount: 202  algorithm: 'Nelder-Mead simplex direct search'  **4.** **用fminunc 函数**  (1)建立M-文件fun2.m  function f=fun2(x)  f=100\*(x(2)-x(1)^2)^2+(1-x(1))^2  (2)主程序wliti44.m  **Rosenbrock函数不同算法的计算结果**  可以看出，最速下降法的结果最差.因为最速下降法特别不适合于从一狭长通道到达最优解的情况.  **例5** **产销量的最佳安排**  某厂生产一种产品有甲、乙两个牌号，讨论在产销平衡的情况下如何确定各自的产量，使总利润最大. 所谓产销平衡指工厂的产量等于市场上的销量.  **符号说明**  *z*(*x1,x2*)表示总利润；  p1，q1，x1分别表示甲的价格、成本、销量；  p2，q2，x2分别表示乙的价格、成本、销量；  aij，bi，λi,ci（i，j =1，2）是待定系数.  **基本假设**  **1．价格与销量成线性关系**  利润既取决于销量和价格，也依赖于产量和成本。按照市场规律，  甲的价格p1会随其销量x1的增长而降低，同时乙的销量x2的增长也  会使甲的价格有稍微的下降，可以简单地假设价格与销量成线性关系，  即： *p1 = b1 - a11 x1 - a12 x2 ，b1，a11，a12*> 0，且*a11 > a12*；  同理， *p2 = b2 - a21 x1- a22 x2 ，b2，a21，a22* > 0  **2．成本与产量成负指数关系**  甲的成本随其产量的增长而降低,且有一个渐进值,可以假设为  负指数关系,即:    同理，  **模型建立**  **总利润为： *z*(*x1,x2*)=(*p1-q1*)*x1*+(*p2-q2*)*x2***  若根据大量的统计数据,求出系数b1=100,a11=1,a12=0.1,b2=280,  a21=0.2,a22=2,r1=30,λ1=0.015,c1=20, r2=100,λ2=0.02,c2=30,则  问题转化为无约束优化问题：求甲,乙两个牌号的产量x1，x2，使  总利润z最大.  为简化模型,先忽略成本,并令a12=0,a21=0,问题转化为求:  z1 = ( b1 - a11x1 ) x1 + ( b2 - a22x2 ) x2  的极值. 显然其解为x1 = b1/2a11 = 50, x2 = b2/2a22 = 70,  我们把它作为原问题的初始值.  **模型求解**  1.建立M-文件fun.m:  function f = fun(x)  y1=((100-x(1)- 0.1\*x(2))-(30\*exp(-0.015\*x(1))+20))\*x(1);  y2=((280-0.2\*x(1)- 2\*x(2))-(100\*exp(-0.02\*x(2))+30))\*x(2);  f=-y1-y2;  2.输入命令:  x0=[50,70];  x=fminunc(‘fun’,x0),  z=fun(x)  3.计算结果:  x=23.9025, 62.4977, z=6.4135e+003  即甲的产量为23.9025,乙的产量为62.4977,最大利润为6413.5.  **非线性规划**   1. **二次规划**   **用MATLAB软件求解,其输入格式如下:**  **1. x=quadprog(H,C,A,b);**  **2. x=quadprog(H,C,A,b,Aeq,beq);**  **3. x=quadprog(H,C,A,b,Aeq,beq,VLB,VUB);**  **4. x=quadprog(H,C,A,b, Aeq,beq ,VLB,VUB,X0);**  **5. x=quadprog(H,C,A,b, Aeq,beq ,VLB,VUB,X0,options);**  **6. [x,fval]=quaprog(...);**  **7. [x,fval,exitflag]=quaprog(...);**  **8. [x,fval,exitflag,output]=quaprog(...);**  **例1 min f(x1,x2)=-2x1-6x2+x12-2x1x2+2x22**  **s.t. x1+x2≤2**  **-x1+2x2≤2**  **x1≥0, x2≥0**  **1、写成标准形式：**  **s.t.**  2、 **输入命令**：  H=[1 -1; -1 2];  c=[-2 ;-6];A=[1 1; -1 2];b=[2;2];  Aeq=[];beq=[]; VLB=[0;0];VUB=[];  [x,z]=quadprog(H,c,A,b,Aeq,beq,VLB,VUB)  3、**运算结果**为：  x =0.6667 1.3333 z = -8.2222  一般非线性规划  标准型为：  *min F(X)*  *s.t* AX<=b  *G(X)*  *Ceq(X)=0 VLBXVUB*  其中*X*为*n*维变元向量，*G(X)*与*Ceq(X)*均为非线性函数组成的向量，其它变量的含义与线性规划、二次规划中相同.用Matlab求解上述问题，基本步骤分三步：  1. 首先建立M文件*fun.m,*定义目标函数F（X）:  *function f=fun(X);*  *f=F(X);*   1. 若约束条件中有非线性约束:*G(X)*或*Ceq(X)=0*,则建立M文件nonlcon.m定义函数G(X)与Ceq(X):   function [G,Ceq]=nonlcon(X)  G=...  Ceq=...  3. 建立主程序.非线性规划求解的函数是fmincon,命令的基本格式如下：  (1) *x=*fmincon*(‘fun’,X0,A,b)*  (2) *x=*fmincon*(‘fun’,X0,A,b,Aeq,beq)*  (3) *x=*fmincon*(‘fun’,X0,A,b, Aeq,beq,VLB,VUB)*  (4) *x=*fmincon*(‘fun’,X0,A,b,Aeq,beq,VLB,VUB,’nonlcon’)*  (5)*x=*fmincon*(‘fun’,X0,A,b,Aeq,beq,VLB,VUB,’nonlcon’,options)*  (6) *[x,fval]=* fmincon(...)  (7) *[x,fval,exitflag]=* fmincon(...)  *(8)[x,fval,exitflag,output]=* fmincon(...)  **注意：**  [1] fmincon函数提供了大型优化算法和中型优化算法。默认时，若在fun函数中提供了梯度（options参数的GradObj设置为’on’），并且只有上下界存在或只有等式约束，fmincon函数将选择大型算法。当既有等式约束又有梯度约束时，使用中型算法。  [2] fmincon函数的中型算法使用的是序列二次规划法。在每一步迭代中求解二次规划子问题，并用BFGS法更新拉格朗日Hessian矩阵。  [3] fmincon函数可能会给出局部最优解，这与初值*X0*的选取有关。  **例2**  s.t.  1、**写成标准形式**：      *s.t.*    2、**先建立M-文件 fun3.m:**  function f=fun3(x);  f=-x(1)-2\*x(2)+(1/2)\*x(1)^2+(1/2)\*x(2)^2  3、再建立主程序youh2.m：  x0=[1;1];  A=[2 3 ;1 4]; b=[6;5];  Aeq=[];beq=[];  VLB=[0;0]; VUB=[];  [x,fval]=fmincon('fun3',x0,A,b,Aeq,beq,VLB,VUB)  4、**运算结果为：**  x = 0.7647 1.0588  fval = -2.0294  例3    1．**先建立M文件 fun4.m,定义目标函数:**  function f=fun4(x);  f=exp(x(1))  \*(4\*x(1)^2+2\*x(2)^2+4\*x(1)\*x(2)+2\*x(2)+1);  **2．再建立M文件mycon.m定义非线性约束：**  function [g,ceq]=mycon(x)  g=[x(1)+x(2);1.5+x(1)\*x(2)-x(1)-x(2);-x(1)\*x(2)-10];  **3．主程序youh3.m为:**  x0=[-1;1];  A=[];b=[];  Aeq=[1 1];beq=[0];  vlb=[];vub=[];  [x,fval]=fmincon('fun4',x0,A,b,Aeq,beq,vlb,vub,'mycon')  3. **运算结果为**：  **x = -1.2250 1.2250**  **fval = 1.8951**  例4．资金使用问题  设有400万元资金, 要求4年内使用完, 若在一年内使用资金*x*万元, 则可得效益万元(效益不能再使用),当年不用的资金可存入银行, 年利率为10%. 试制定出资金的使用计划, 以使4年效益之和为最大.  设变量表示第*i*年所使用的资金数,则有    1．**先建立M文件 fun44.m,定义目标函数:**  function f=fun44(x)  f=-(sqrt(x(1))+sqrt(x(2))+sqrt(x(3))+sqrt(x(4)));  **2．再建立M文件mycon1.m定义非线性约束：**  function [g,ceq]=mycon1(x)  g(1)=x(1)-400;  g(2)=1.1\*x(1)+x(2)-440;  g(3)=1.21\*x(1)+1.1\*x(2)+x(3)-484;  g(4)=1.331\*x(1)+1.21\*x(2)+1.1\*x(3)+x(4)-532.4;  ceq=0  **3．主程序youh4.m为:**  x0=[1;1;1;1];vlb=[0;0;0;0];vub=[];A=[];b=[];Aeq=[];beq=[];  [x,fval]=fmincon('fun44',x0,A,b,Aeq,beq,vlb,vub,'mycon1')  得到    MATLAB分支定界法求解(非常急)  MATLAB分支定界法悬赏分：200 - 解决时间：2008-3-26 14:00  题目:min (4\*x1+4\*x2); 约束条件:2\*x1+5\*x2<=15,2\*x1-2\*x2<=5,x1,x2>=0,且都为整数. 解这个还是很容易,算出来x1,x2都为0点几,因为题目要求是整数,所以主要是这个分支定界的问题,急求一个分支定界的MATLAB算法,通用算法也可以,或者只能解这道题也可以,只要能进行计算就行,最后解出来x1,x2都为0.    把以下程序存为ILP.m， %============================ function [x,y]=ILp(f,G,h,Geq,heq,lb,ub,x,id,options) %整数线性规划分支定界法，可求解纯整数规划和混合整数规划。 %y=minf’\*x s.t. G\*x<=h Geq\*x=heq x为全整数或混合整数列向量 %用法 %[x,y]=ILp(f,G,h,Geq,heq,lb,ub,x,id,options) %参数说明 %lb:解的下界列向量（Default:-int） %ub:解的上界列向量（Default:int） %x:迭代初值列向量 %id：整数变量指标列向量，1-整数，0-实数（Default:1） global upper opt c x0 A b Aeq beq ID options; if nargin<10,options=optimset({});options.Display='off'; options.LargeScale='off';end if nargin<9,id=ones(size(f));end if nargin<8,x=[];end if nargin<7 |isempty(ub),ub=inf\*ones(size(f));end if nargin<6 |isempty(lb),lb=zeros(size(f));end if nargin<5,heq=[];end if nargin<4,Geq=[];end upper=inf;c=f;x0=x;A=G;b=h;Aeq=Geq;beq=heq;ID=id; ftemp=ILP(lb(:),ub(:)); x=opt;y=upper; %下面是子函数 function ftemp=ILP(vlb,vub) global upper opt c x0 A b Aeq beq ID options; [x,ftemp,how]=linprog(c,A,b,Aeq,beq,vlb,vub,x0,options); if how <=0 return; end; if ftemp-upper>0.00005 %in order to avoid error return; end; if max(abs(x.\*ID-round(x.\*ID)))<0.00005 if upper-ftemp>0.00005 %in order to avoid error opt=x';upper=ftemp; return; else opt=[opt;x']; return; end; end; notintx=find(abs(x-round(x))>=0.00005); %in order to avoid error intx=fix(x);tempvlb=vlb;tempvub=vub; if vub(notintx(1,1),1)>=intx(notintx(1,1),1)+1; tempvlb(notintx(1,1),1)=intx(notintx(1,1),1)+1; ftemp=IntLP(tempvlb,vub); end; if vlb(notintx(1,1),1)<=intx(notintx(1,1),1) tempvub(notintx(1,1),1)=intx(notintx(1,1),1); ftemp=IntLP(vlb,tempvub); end; %==================================== 然后：   clc;clear f=[4 4] A=[2 5;2 -2] b=[15;5] Aeq=[];beq=[]; LB=[0 0];UB=[]; [xn,yn]=ILp(f,A,b,Aeq,beq,LB,UB,[1 1],1,[]) [x,fval,exitflag]=linprog(f,A,b,Aeq,beq,LB,UB)  function [p\_opt,fval]=dynprog(x,DecisFun,ObjFun,TransFun)  % [p\_opt,fval]=dynprog(x,DecisFun,ObjFun,TransFun)  % 自由始端和终端的动态规划,求指标函数最小值的逆序算法递归  % 计算程序。x是状态变量，一列代表一个阶段状态；M-函数  % DecisFun(k,x)由阶段k的状态变量x求出相应的允许决策变量;  % M-函数ObjFun(k,x,u)是阶段指标函数，M-函数TransFun(k,x,u)  % 是状态转移函数,其中x是阶段k的某状态变量，u是相应的决策变量；  % 输出p\_opt由4列构成，p\_opt=[序号组;最优策略组;最优轨线组;  % 指标函数值组]；fval是一个列向量，各元素分别表示p\_opt各  % 最优策略组对应始端状态x的最优函数值；  %  %先写3个函数  % eg13f1\_2.m  % function u=DecisF\_1(k,x)  % 在阶段k由状态变量x的值求出其相应的决策变量所有的取值  % c=[70,72,80,76];q=10\*[6,7,12,6];  % if q(k)-x<0,u=0:100; %决策变量不能取为负值  % else,u=q(k)-x:100;end; %产量满足需求且不超过100  % u=u(:);  % eg13f2\_2.m  % function v=ObjF\_1(k,x,u)  % 阶段k的指标函数  % c=[70,72,80,76];v=c(k)\*u+2\*x;  % eg13f3\_2.m  % function y=TransF\_1(k,x,u)  % 状态转移方程  % q=10\*[6,7,12,6];y=x+u-q(k);  %调用DynProg.m计算如下：  % clear;x=nan\*ones(14,4);% x是10的倍数，最大范围0≤x≤130,  % %因此x=0,1,...13，所以x初始化取14行，nan表示无意义元素  % x(1:7,1)=10\*(0:6)'; % 按月定义x的可能取值  % x(1:11,2)=10\*(0:10)';x(1:12,3)=10\*(2:13)';  % x(1:7,4)=10\*(0:6)';  % [p,f]=dynprog(x,'eg13f1\_2','eg13f2\_2','eg13f3\_2')  % By X.D. Ding June 2000  k=length(x(1,:));  f\_opt=nan\*ones(size(x));d\_opt=f\_opt;  t\_vubm=inf\*ones(size(x));x\_isnan=~isnan(x);t\_vub=inf;  % 计算终端相关值  tmp1=find(x\_isnan(:,k));tmp2=length(tmp1);  for i=1:tmp2  u=feval(DecisFun,k,x(i,k));tmp3=length(u);  for j=1:tmp3  tmp=feval(ObjFun,k,x(tmp1(i),k),u(j));  if tmp<=t\_vub,  f\_opt(i,k)=tmp;d\_opt(i,k)=u(j);t\_vub=tmp;  end;end;end  % 逆推计算各阶段的递归调用程序  for ii=k-1:-1:1  tmp10=find(x\_isnan(:,ii));tmp20=length(tmp10);  for i=1:tmp20  u=feval(DecisFun,ii,x(i,ii));tmp30=length(u);  for j=1:tmp30  tmp00=feval(ObjFun,ii,x(tmp10(i),ii),u(j));  tmp40=feval(TransFun,ii,x(tmp10(i),ii),u(j));  tmp50=x(:,ii+1)-tmp40;  tmp60=find(tmp50==0);  if ~isempty(tmp60),  tmp00=tmp00+f\_opt(tmp60(1),ii+1);  if tmp00<=t\_vubm(i,ii)  f\_opt(i,ii)=tmp00;d\_opt(i,ii)=u(j);  t\_vubm(i,ii)=tmp00;  end;end;end;end;end;  fval=f\_opt(tmp1,1);  % 记录最优决策、最优轨线和相应指标函数值  p\_opt=[];tmpx=[];tmpd=[];tmpf=[];  tmp0=find(x\_isnan(:,1));tmp01=length(tmp0);  for i=1:tmp01,  tmpd(i)=d\_opt(tmp0(i),1);  tmpx(i)=x(tmp0(i),1);  tmpf(i)=feval(ObjFun,1,tmpx(i),tmpd(i));  p\_opt(k\*(i-1)+1,[1,2,3,4])=[1,tmpx(i),...  tmpd(i),tmpf(i)];  for ii=2:k  tmpx(i)=feval(TransFun,ii-1,tmpx(i),tmpd(i));  tmp1=x(:,ii)-tmpx(i);tmp2=find(tmp1==0);  if ~isempty(tmp2)  tmpd(i)=d\_opt(tmp2(1),ii);  end;  tmpf(i)=feval(ObjFun,ii,tmpx(i),tmpd(i));  p\_opt(k\*(i-1)+ii,[1,2,3,4])=[ii,tmpx(i),...  tmpd(i),tmpf(i)];  end;end;  某厂与用户订立合同，在四个月内出售一定数量的某种产品，产量限制为10的倍数，工厂每月最多生产100件，产品可以存储，存储费用为每台2百元，每个月的需求量及每件产品的生产成本见下表：   |  |  |  | | --- | --- | --- | | 月份 | 每件生产成本（百元） | 需求量（件） | | 1 | 70 | 60 | | 2 | 72 | 70 | | 3 | 80 | 120 | | 4 | 76 | 60 |   现在分别在（1）1月初没有存货可用和（2）1月初有20件存货可用这两种情况下确定每月的生产量，要求既能满足每月的合同需求量，又使生产成本和存储费用达到最小. | | | | | |