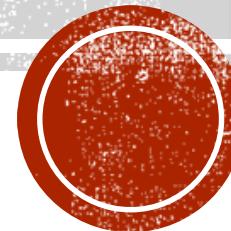


# Lect06. Branch and Bound





# Branch and Bound

- Illustrating Branch-and-Bound with the 0-1 Knapsack Problem
- The Traveling Salesperson Problem

# What is Branch-and-Bound?

## Features

1. An improvement on the backtracking algorithm.
2. Similar to backtracking, **a state space tree is used**.
3. Does not limit us to any particular way of traversing the tree.
4. It is used only for the **optimization problem**.

## Principle of Branch-and-Bound

- Branch-and-Bound algorithm computes a number (**bound**) at a node to determine whether the node is **promising**.
- The bound is a limitation of solutions to be get **branching** from the node
- If the bound is not good comparing optimal solution, there is no necessary to branch anymore and the node is **nonpromising**.

P.S: the 0-1 Knapsack problem in Section 5.7 is actually a branch-and-bound algorithm.

# 0-1 knapsack problem

- 분기한정 가지치기로 깊이우선검색 (= 되추적)
  - 상태공간트리를 구축하여 되추적 기법으로 문제를 푼다.
  - 뿌리마디에서 왼쪽으로 가면 첫번째 아이템을 배낭에 넣는 경우이고, 오른쪽으로 가면 첫번째 아이템을 배낭에 넣지 않는 경우이다.
  - 동일한 방법으로 트리의 수준 1에서 왼쪽으로 가면 두 번째 아이템을 배낭에 넣는 경우이고, 오른쪽으로 가면 그렇지 않는 경우이다.
  - 이런 식으로 계속하여 상태공간트리를 구축하면, 뿌리마디로부터 잎마디까지의 모든 경로는 해답후보가 된다.
  - 이 문제는 최적의 해를 찾는 문제(**optimization problem**)이므로 검색이 완전히 끝나기 전에는 해답을 알 수가 없다. 따라서 검색을 하는 과정 동안 항상 그 때까지 찾은 최적의 해를 기억해 두어야 한다.

# General backtracking for solving optimization

```
■ void checknode(node v) {  
    node u;  
    if(value(v) is better than best)  
        best = value(v);  
    if(promising(v))  
        for(each child u of v)  
            checknode(u);  
}
```

- best : 지금까지 찾은 제일 좋은 해답치.
- value(v) : v 마디에서의 해답치.

# 0-1 Knapsack Problem: Algorithm

## ■ 알고리즘 스켓치:

### ■ Let:

- *profit* : 그 마디에 오기까지 넣었던 아이템의 값어치의 합.
- *weight* : 그 마디에 오기까지 넣었던 아이템의 무게의 합.
- *bound* : 마디가 수준 *i*에 있다고 하고, 수준 *k*에 있는 마디에서 총무게가 *W*를 넘는다고 하자. 그러면

$$totweight = weight + \sum_{j=i+1}^{k-1} w_j$$

$$bound = \left( profit + \sum_{j=i+1}^{k-1} p_j \right) + (W - totweight) \times \frac{p_k}{w_k}$$

- *maxprofit* : 지금까지 찾은 최선의 해답이 주는 값어치
- $w_i$ 와  $p_i$ 를 각각 *i*번째 아이템의 무게와 값어치라고 하면,  $p_i / w_i$ 의 값이 큰 것부터 내림차순으로 아이템을 정렬한다. (일종의 탐욕적인 방법이 되는 셈이지만, 알고리즘 자체는 탐욕적인 알고리즘은 아니다.)
- $maxprofit := \$0; profit := \$0; weight := 0$

# 0-1 Knapsack Problem

- 깊이우선순위로 각 마디를 방문하여 다음을 수행한다:
  1. 그 마디의 *profit*와 *weight*를 계산한다.
  2. 그 마디의 *bound*를 계산한다.
  3.  $\text{weight} < W$  and  $\text{bound} > \text{maxprofit}$ 이면, 검색을 계속한다;  
그렇지 않으면, 되추적.
- 고찰: 최선이라고 여겼던 마디를 선택했다고 해서 실제로 그 마디로부터 최적해가 항상 나온다는 보장은 없다.

- 보기:  $n = 4$ ,  $W = 16$ 이고 일 때, 되추적을 사용하여 구축되는 가지친 상태공간트리를 그려 보시오.

$i$	$p_i$	$w_i$	$\frac{p_i}{w_i}$
1	\$40	2	\$20
2	\$30	5	\$6
3	\$50	10	\$5
4	\$10	5	\$2

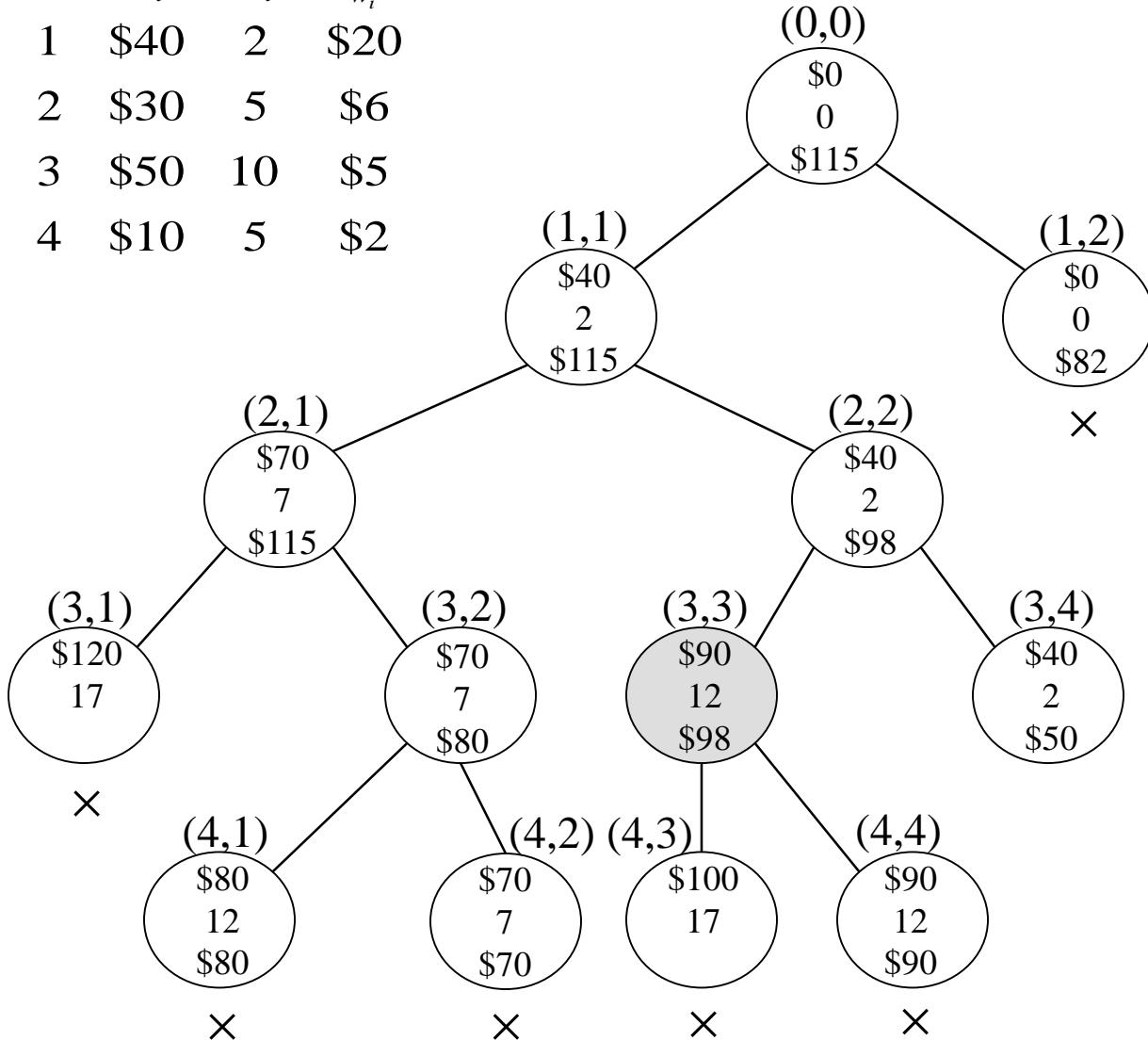
item 1  $\begin{bmatrix} \$40 \\ 2 \end{bmatrix}$

item 2  $\begin{bmatrix} \$30 \\ 5 \end{bmatrix}$

item 3  $\begin{bmatrix} \$50 \\ 10 \end{bmatrix}$

item 4  $\begin{bmatrix} \$10 \\ 5 \end{bmatrix}$

$i$	$p_i$	$w_i$	$\frac{p_i}{w_i}$
1	\$40	2	\$20
2	\$30	5	\$6
3	\$50	10	\$5
4	\$10	5	\$2



## 0-1 Knapsack problem: Analysis

- 이 알고리즘이 점검하는 마디의 수는  $\Theta(2^n)$ 이다.
- 위 보기의 경우의 분석: 점검한 마디는 13개이다. 이 알고리즘이 동적계획법으로 설계한 알고리즘 보다 좋은가?
  - 확실하게 대답하기 불가능 하다.
  - Horowitz와 Sahni(1978)는 Monte Carlo 기법을 사용하여 되추적 알고리즘이 동적계획법 알고리즘 보다 일반적으로 더 빠르다는 것을 입증하였다.
  - Horowitz와 Sahni(1974)가 분할정복과 동적계획법을 적절히 조화하여 개발한 알고리즘은  $O(2^{n/2})$ 의 시간 복잡도를 가지는데, 이 알고리즘은 되추적 알고리즘 보다 일반적으로 빠르다고 한다.

12

# Breadth-First Branch-and-Bound

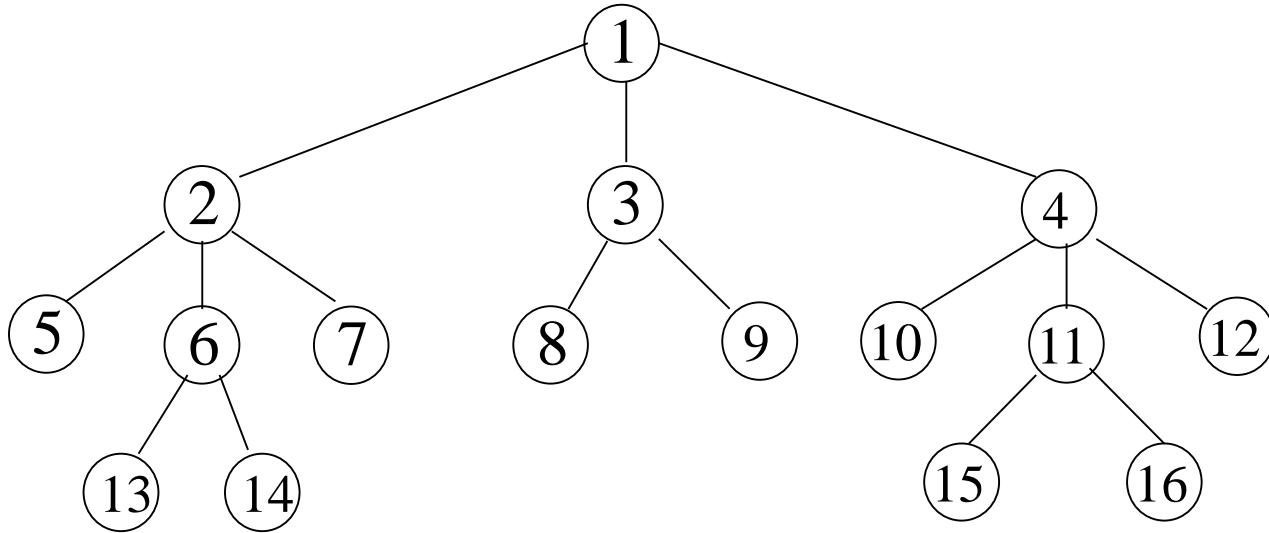


# Breadth-First Branch-and-Bound

■ 너비우선검색(Breadth-first Search) 순서:

- (1) 뿌리마디를 먼저 검색한다.
- (2) 다음에 수준 1에 있는 모든 마디를 검색한다.  
(왼쪽에서 오른쪽으로)
- (3) 다음에 수준 2에 있는 모든 마디를 검색한다  
(왼쪽에서 오른쪽으로)
- (4) ...

# Breadth-First Search of a Tree



# BFS algorithm

- 되부름(recursive) 알고리즘을 작성하기는 상당히 복잡하다. 따라서 대기열(queue)을 사용한다.

```
void breadth_first_search(tree T) {  
    queue_of_node Q;  
    node u, v;  
    initialize(Q);  
    v = root of T;  
    visit v;  
    enqueue(Q, v);  
    while( !empty(Q) ) {  
        dequeue(Q, v);  
        for(each child u of v) {  
            visit u;  
            enqueue(Q, u);  
        }  
    }  
}
```

# BFS algorithm with Bound\_and\_Branch

```
void breadth_first_branch_and_bound(state_space_tree T,
                                     number& best) {
    queue_of_node Q;
    node u, v;
    initialize(Q);           // Q는 빈 대기열로 초기화
    v = root of T;           // 뿌리마디를 방문
    enqueue(Q,v);
    best = value(v);
    while(!empty(Q)) {
        dequeue(Q,v);
        for(each child u of v) { // 각 자식마디를 방문
            if(value(u) is better than best)
                best = value(u);
            if(bound(u) is better than best)
                enqueue(Q,u);
        }
    }
}
```

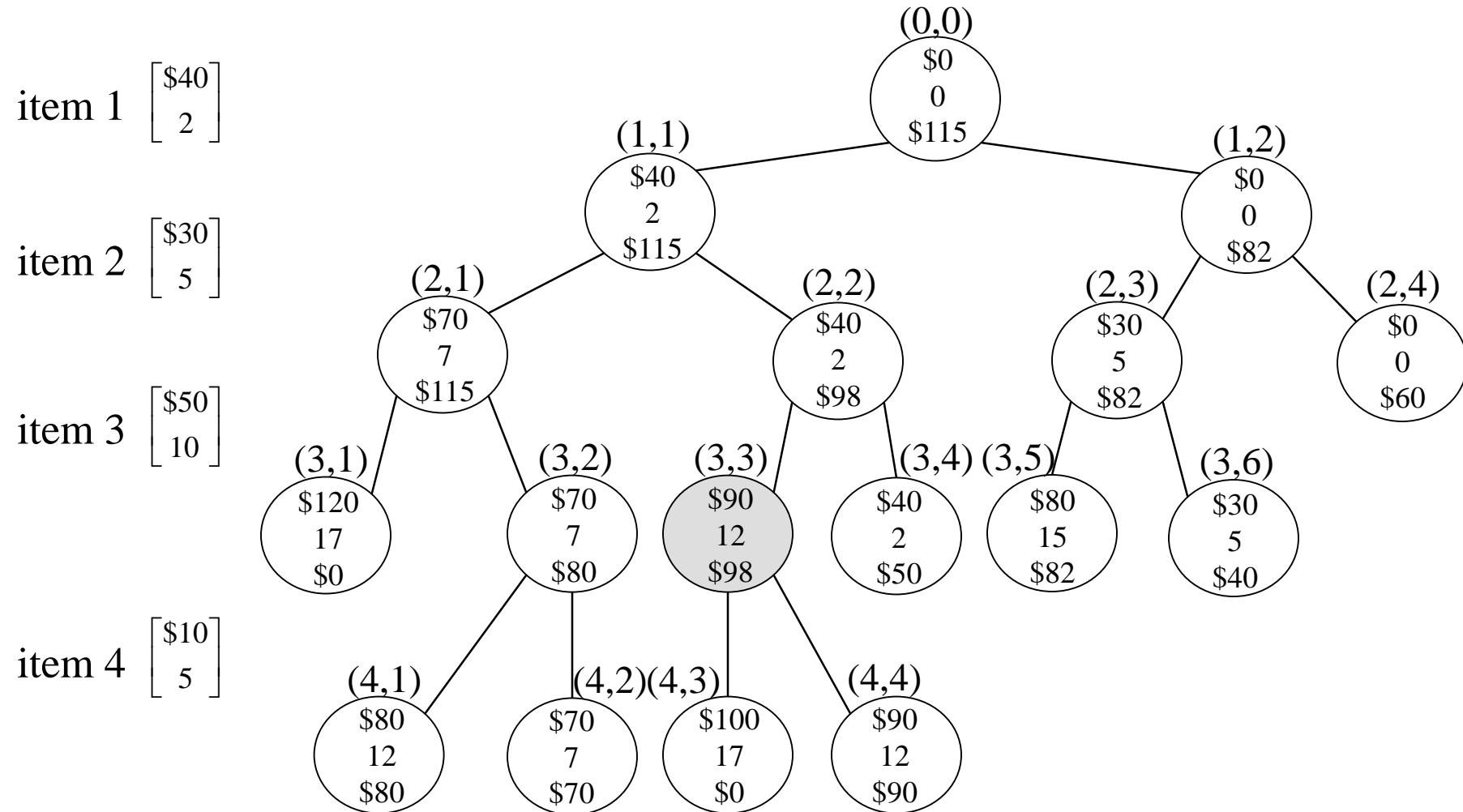
## Algorithm 6.1

```
void knapsack2(int n, const int p[], const int w[], int W, int maxprofit)
{
    queue_of_node Q;    node u, v;
    initialize(Q);      v.level = 0;  v.profit = 0;  v.weight = 0;
    maxprofit = 0;       enqueue(Q, v);
    while (!empty(Q)){
        dequeue(Q, v);
        u.level = v.level+1;
        u.weight = v.weight +w[u.level];
        u.profit = v.profit+p[u.level];
        if (u.weight <=W && u.profit>maxprofit )
            maxprofit = u.profit;
        if (bound(u) > maxprofit)
            enqueue(Q, u);
        u.weight = v.weight;          u.profit = v.profit;
        if (bound(u) > maxprof)
            enqueue(Q, u);
    }
}
```

## Algorithm 6.1 (Cont'd)

```
float bound(node u)
{   index j, k ;   int totalweight ;   float result ;
    if (u.weight >=W)
        return 0;
    else {  result = u.profit ;
            j = u.level+1 ;  totweight = u.weight ;
            while (j <=n && totweight+w[j]<=W ){
                totweight= totweight+w[j];
                result= result+p[j];
                j++;
            }
            k = j ;
            if (k <= n)
                result= result+(W-totweight)×p[k]/w[k];
            return result ; //cf. backtracking, in promising(i),
    }                      // return (return>maxprofit);
}
```

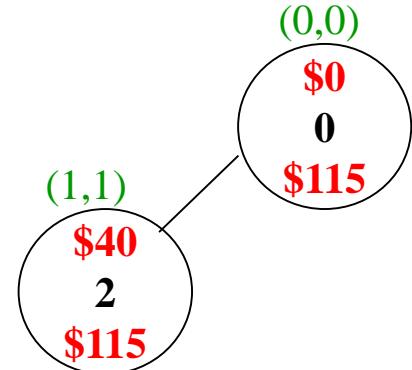
- 보기: 앞에서와 같은 예를 사용하여 분기한정 가지치기로 너비우선검색을 하여 가지친 상태공간트리를 그려보면 다음과 같이 된다. 이때 검색하는 마디의 개수는 **17**이다. 되추적 알고리즘보다 좋지 않다!



## Example 6.1(BFS with Branch-and-Bound)

Suppose that  $n = 4$ ,  $W=16$ , and we have the following

$i$	$p_i$	$w_i$	$p_i/w_i$
1	\$40	2	\$20
2	\$30	5	\$6
3	\$50	10	\$5
4	\$10	5	\$2



Find the solutions.

Sol :

1. Set  $maxprofit = 0$
2. Visit node(0,0)  
 $profit = 0$   
 $weight = 0$   
 $totweight = 0+2+5=7$   
 $bound = 0+40+30+(16-7)*50/10=115$
3. Visit node (1,1) :  $profit = 40$        $weight = 2$      $maxprofit = 40$   
 $bound = 40+30+(16-7)*50/10$ ,  $totweight=2+5=7$

# Example 6.1 (Cont'd)

$n = 4, W=16,$

4. Visit node(1,2)

$$profit = 0, totweight=5+10=15, maxprofit=40$$

$$weight = 0 \quad bound=30+50+(16-15)*10/5=82$$

5. Visit node (2,1)

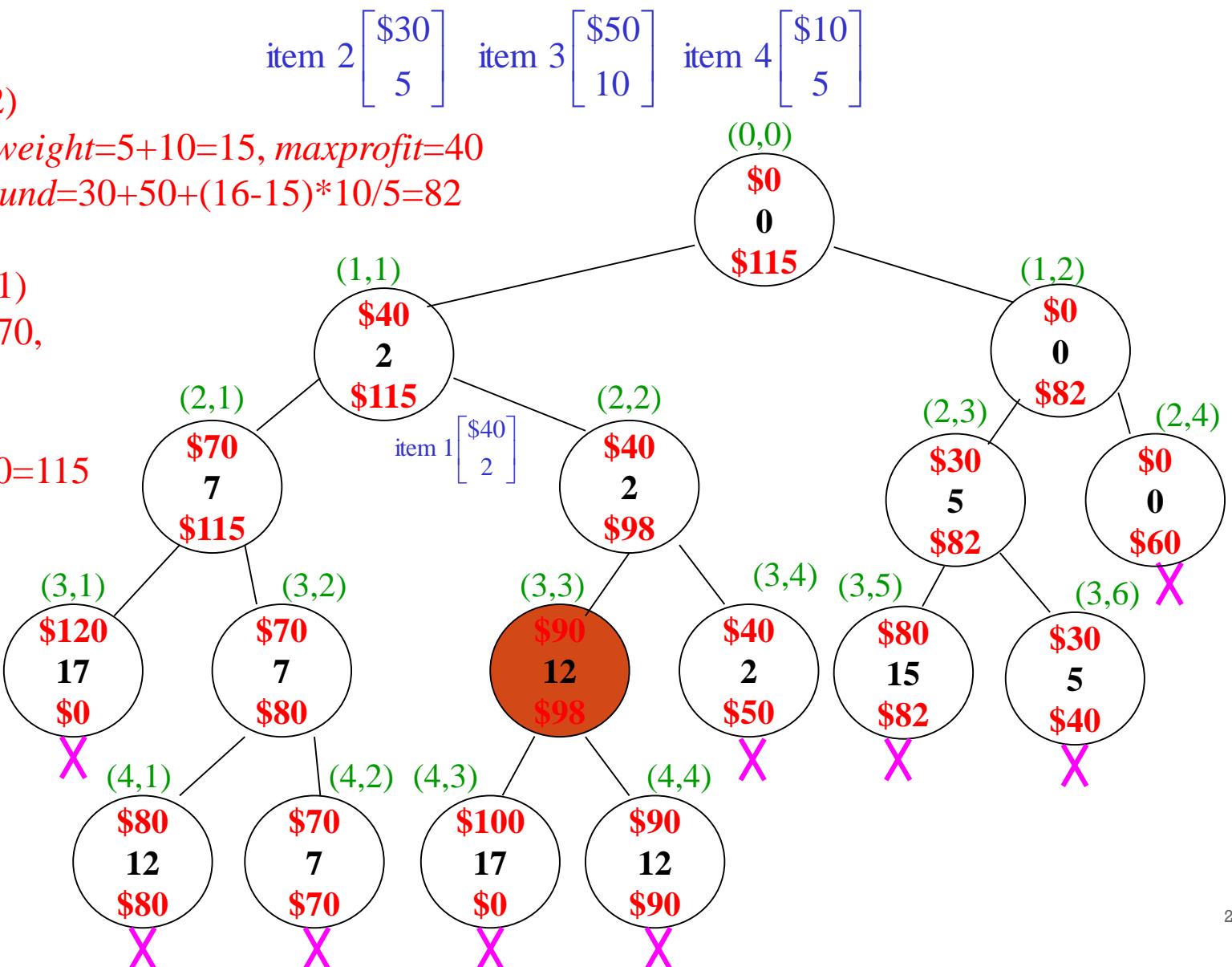
$$profit=40+30=70,$$

$$weight =2+5=7$$

bound=

$$70+(16-7)*50/10=115$$

maxprofit=70



# Example 6.1 (Cont'd)

$n = 4, W=16,$

6. Visit node(2,2)

$profit = 40, totweight=2+10=12, maxprofit = 70$

$weight = 2 bound=40+50+(16-12)*10/5=98$

7. Visit node (2,3)

$profit=30, totweight=5+10=15$

$weight =5$

$bound=$

$30+50+(16-15)*10/5$   
 $=82$

$maxprofit=70$

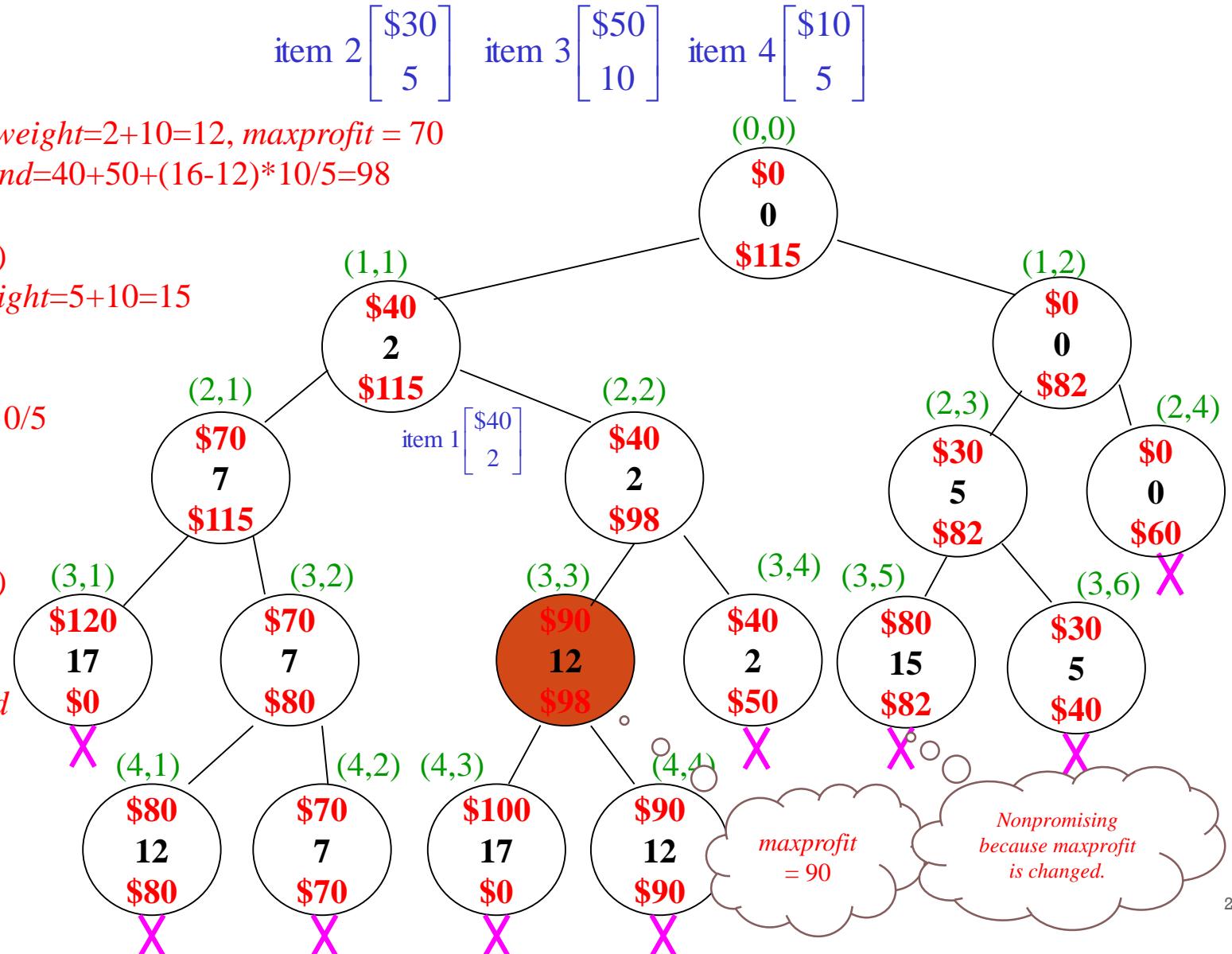
8. Visit node (2,4)

$profit=30$

$bound=60$

$maxprofit > bound$

: no expand



# Best-First Search with Brach\_and\_Bound

# Illustrating Branch-and-Bound with the 0-1 Knapsack Problem

1. Breadth-First Search with Branch-and-Bound Pruning for the 0-1 Knapsack problem.
2. Best-First Search with Branch-and-Bound Pruning for the 0-1 Knapsack problem : an improvement of 1.

▪ *profit* : 그 마디에 오기까지 넣었던 아이템의 값어치의 합.

▪ *weight* : 그 마디에 오기까지 넣었던 아이템의 무게의 합.

▪ *bound* : 마디가 수준  $i$ 에 있다고 하고, 수준  $k$ 에 있는 마디에서 총무게가  $\frac{k-i}{W}$ 를 넘는다고 하자. 그러면

$$bound = \left( profit + \sum_{j=i+1}^{k-1} p_j \right) + (W - totweight) \times \frac{p_k}{w_k}$$

▪ *maxprofit* : 지금까지 찾은 최선의 해답이 주는 값어치

▪  $w_i$ 와  $p_i$ 를 각각  $i$ 번째 아이템의 무게와 값어치라고 하면,  $p_i/w_i$ 의 값이 큰 것부터 내림차순으로 아이템을 정렬한다. (일종의 탐욕적인 방법이 되는 셈이지만, 알고리즘 자체는 탐욕적인 알고리즘은 아니다.)

▪  $maxprofit := \$0; profit := \$0; weight := 0$

A node is nonpromising if this bound is less than or equal to  $maxprofit$  or  $weight \geq W$ .

## Best-First Search algorithm with Branch\_and\_Bound

- 최적의 해답에 더 빨리 도달하기 위한 전략:
  1. 주어진 마디의 모든 자식마디를 검색한 후,
  2. 유망하면서 확장되지 않은(**unexpanded**) 마디를 살펴보고,
  3. 그 중에서 가장 좋은(최고의) 한계치(**bound**)를 가진 마디를 확장한다.
- 최고우선검색(Best-First Search)은 너비우선검색에 비해서 좋아짐

# Best-First Search Strategy

- 최고의 한계를 가진 마디를 우선적으로 선택하기 위해서 우선순위 대기열 (Priority Queue)을 사용한다.
- 우선순위 대기열은 힙(heap)을 사용하여 효과적으로 구현할 수 있다.

# Branch-and-Bound Pruning

- Best-first search with branch-and-bound pruning:

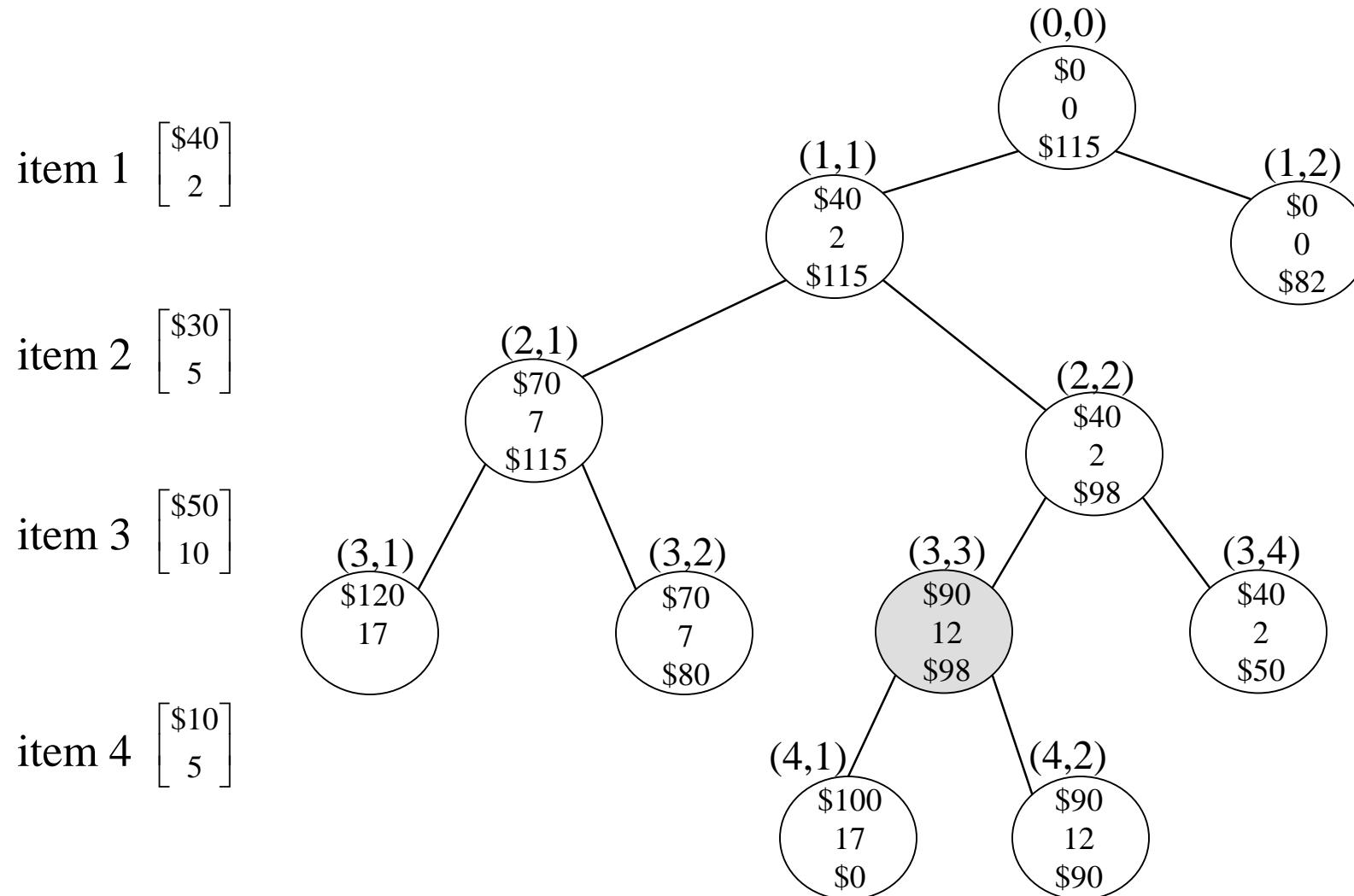
A simple modification of the approach called breadth-first search (review algorithm) with branch-and-bound pruning.

```
void breadth_first_tree_search(tree  $T$ )
{
    queue_of_node  $Q$ ;      node  $u, v$  ;
    initialize( $Q$ );    $v$  = root of  $T$  ;
    visit  $v$ ;   enqueue( $Q, v$ );
    while (!empty( $Q$ )){
        dequeue( $Q, v$ );
        for (each child  $u$  of  $v$ ){
            visit  $u$ ;
            enqueue( $Q, u$ );
        }
    }
}
```

# Best-First Algorithm with Branch\_and\_Bound

```
void best_first_branch_and_bound(state_space_tree T,
                                  number best) {
    priority_queue_of_node PQ;
    node u,v;
    initialize(PQ); // PQ를 빈 대기열로 초기화
    v = root of T;
    best = value(v);
    insert(PQ,v);
    while( !empty(PQ)) { // 최고 한계값을 가진 마디를 제거
        remove(PQ,v);
        if(bound(v) is better than best) // 마디가 아직 유망한지 점검
            for(each child u of v) {
                if(value(u) is better than best)
                    best = value(u);
                if(bound(u) is better than best)
                    insert(PQ,u);
            }
    }
}
```

- 보기: 앞에서와 같은 예를 사용하여 분기한정 가지치기로 최고우선검색을 하여 가지친 상태공간 트리를 그려보면, 다음과 같이 된다. 이때 검색하는 마디의 개수는 **11**이다.



## Example 6.2(Best-First Search with Branch-and-Bound)

Suppose that  $n = 4$ ,  $W=16$ , and we have the following

$i$	$p_i$	$w_i$	$p_i/w_i$
1	\$40	2	\$20
2	\$30	5	\$6
3	\$50	10	\$5
4	\$10	5	\$2

Find the solutions.

Sol :

1. Set  $maxprofit = 0$
2. Visit node(0,0)

$$profit = 0 \dots maxprofit=0$$

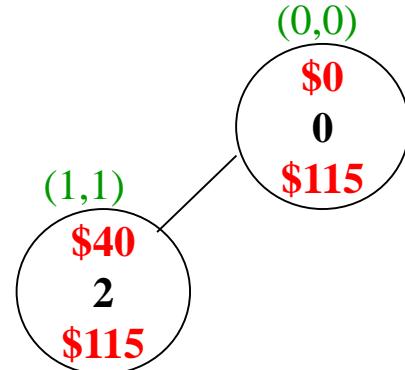
$$weight = 0, totweight=0+2+5=7$$

$$bound = 0+40+30+(16-7)*50/10=115$$

3. Visit node (1,1) :

$$profit = 40 \ weight = 2 \ profit = 40 \ weight = 2 \ maxprofit = 40$$

$$bound = 40+30+(16-7)*50/10=115, totweight=2+5=7$$



## Example 6.2 (Cont'd)

$n = 4, W=16,$

4. Visit node(1,2)

$profit = 0, totweight=5+10=15 maxprofit=40$   
 $weight = 0 bound=30+50+(16-15)*10/5=82$

5. Not extended & promising node

(1,1)-bound 115, (1,2)-bound 82

child of (1,1) : (2,1) & (2,2)

6. Visit node (2,1)

$profit=40+30=70,$   
 $weight = 2+5=7$

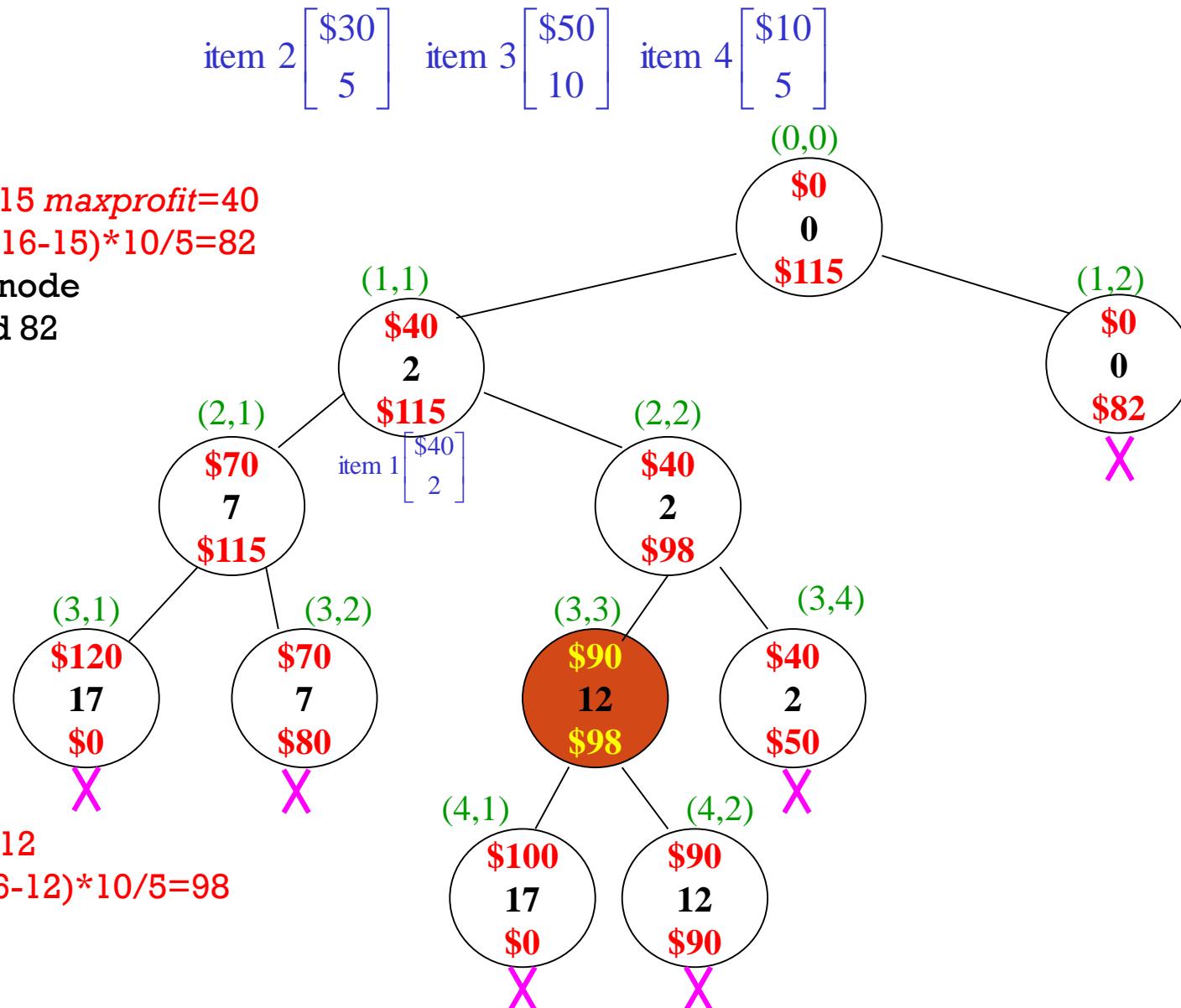
$bound=$

$70+(16-7)*50/10=115$

$maxprofit=70$

7. Visit node(2,2)

$profit = 40, totweight=2+10=12$   
 $weight = 2 bound=40+50+(16-12)*10/5=98$



## Example 6.2 (Cont'd)

$n = 4, W=16,$

8. Not extended, max bound & promising node (2,1)  
its children (3,1) (3,2)

9. Visit node (3,1)  
 $profit=40+30+50=120$ ,

$totweight=2+5=7$

$weight = 2+5+10=17$ : no promising  
 $bound=0$  : no expand  
 $maxprofit=70$

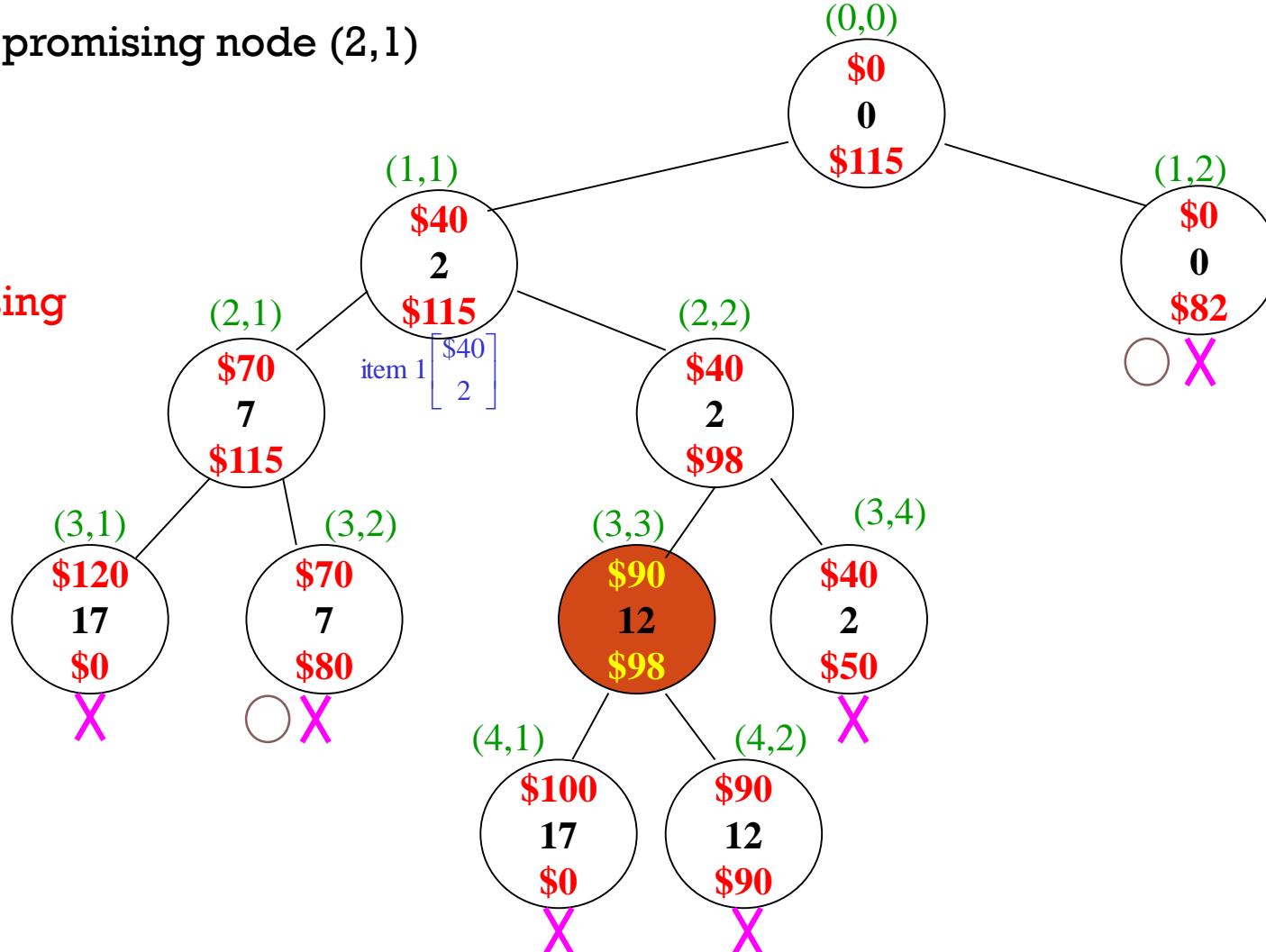
10. Visit node (3,2)

$profit=70$

$w=2+5=7$

$bound=40+30+10=80$

item 2  $\begin{bmatrix} \$30 \\ 5 \end{bmatrix}$  item 3  $\begin{bmatrix} \$50 \\ 10 \end{bmatrix}$  item 4  $\begin{bmatrix} \$10 \\ 5 \end{bmatrix}$



## Example 6.2 (Cont'd)

$n = 4, W=16,$

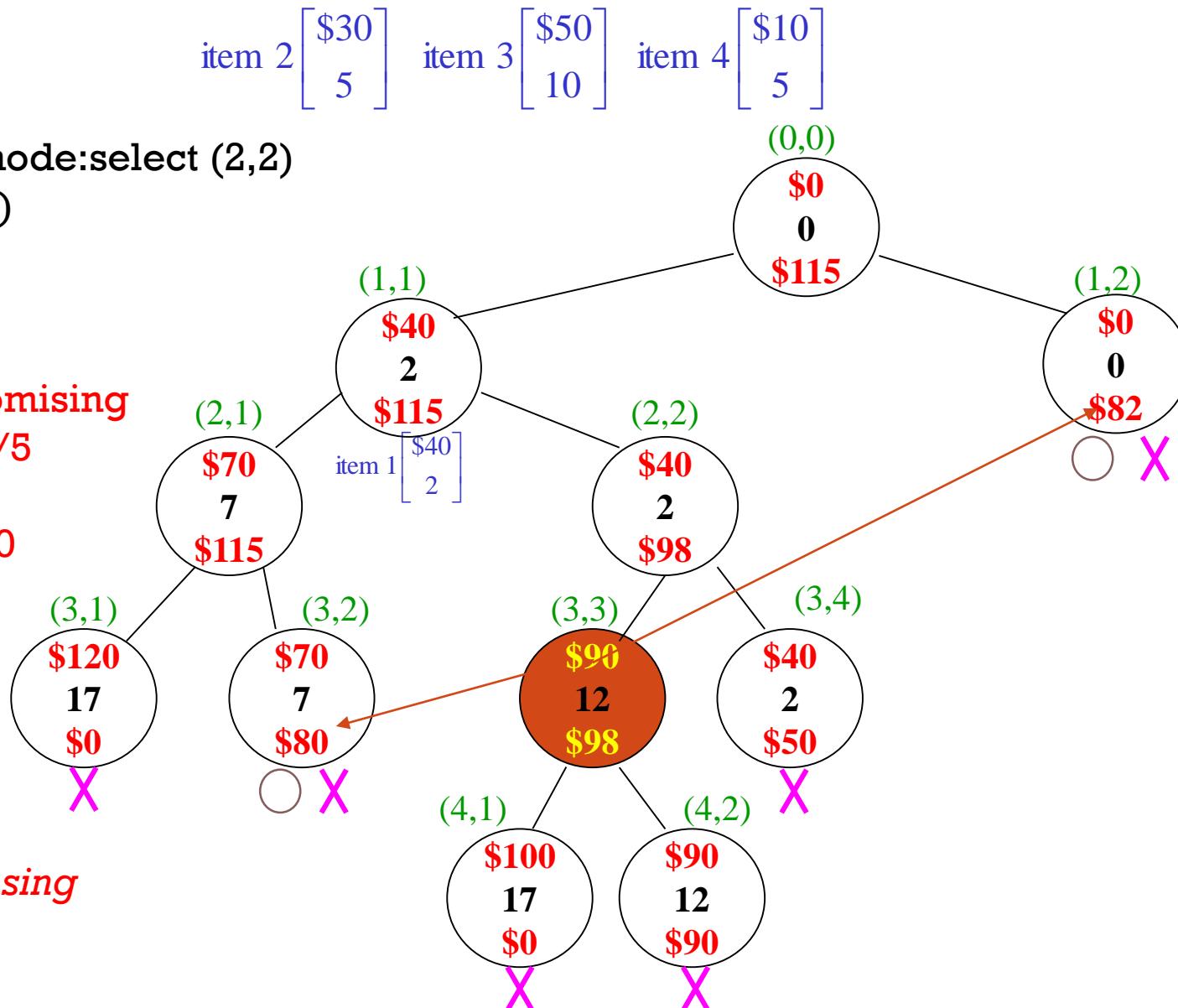
11. Max bound promising node:select (2,2)  
its children (3,3) ans (3,4)

12. Visit node (3,3)  
 $profit=40+50=90,$   
 $totweight=2+5=7$   
 $weight = 2+5+10=17:$  nonpromising  
 $bound=40+50+(16-12)*10/5$   
 $= 98$

$profit > maxprofit(=70) \Rightarrow 90$

13. ((3,2)&(1,2) node  
bound < maxprofit  
: nonpromising

14. Visit node (3,4)  
 $profit=40$   
 $w=2$   $bound=40+10=50$   
 $bound < maxprofit: nonpromising$

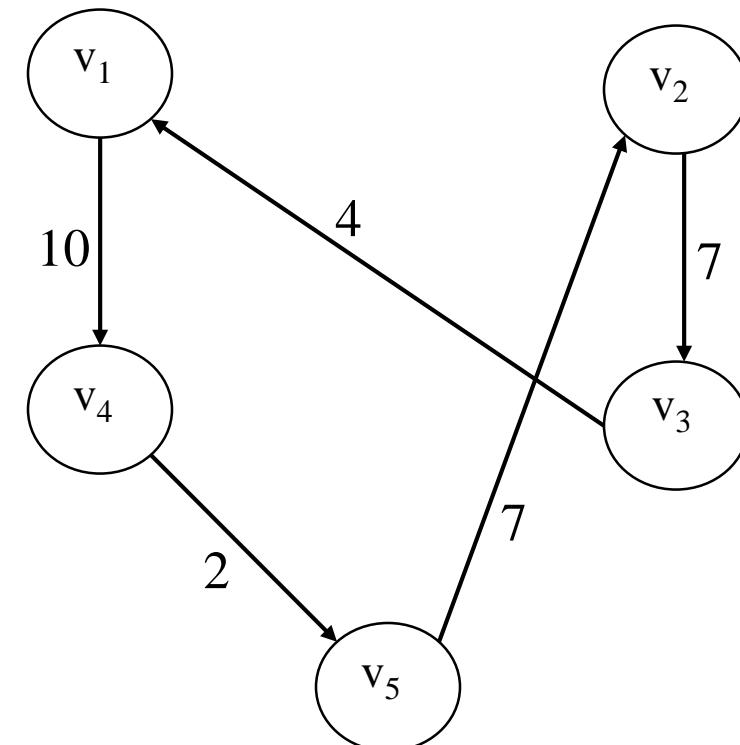


# The Traveling Salesperson Problem

# TSP with Branch\_and\_Bound

- $n = 40$ 일 때, 동적계획법 알고리즘은 6년 이상이 걸린다. 그러므로 분기한정법을 시도해 본다.
- 보기: 다음 인접행렬로 표현된 그래프를 살펴보시오.

$$\begin{bmatrix} 0 & 14 & 4 & 10 & 20 \\ 14 & 0 & 7 & 8 & 7 \\ 4 & 5 & 0 & 7 & 16 \\ 11 & 7 & 9 & 0 & 2 \\ 18 & 7 & 17 & 4 & 0 \end{bmatrix}$$



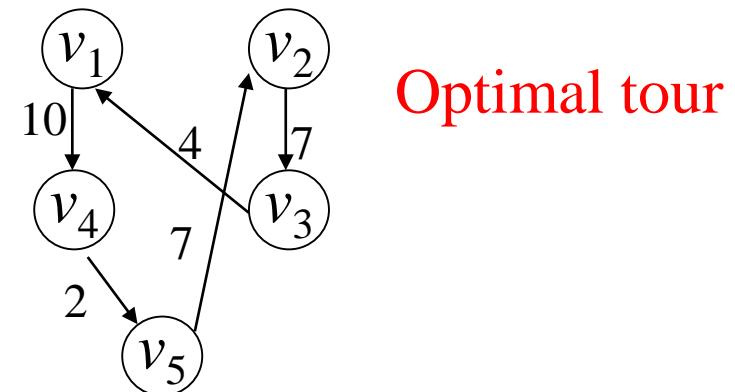
# The Traveling Salesperson Problem

How to find the optimal tour more efficient than using backtracking?

**Branch-and-Bound** can be considered for searching the state space tree.

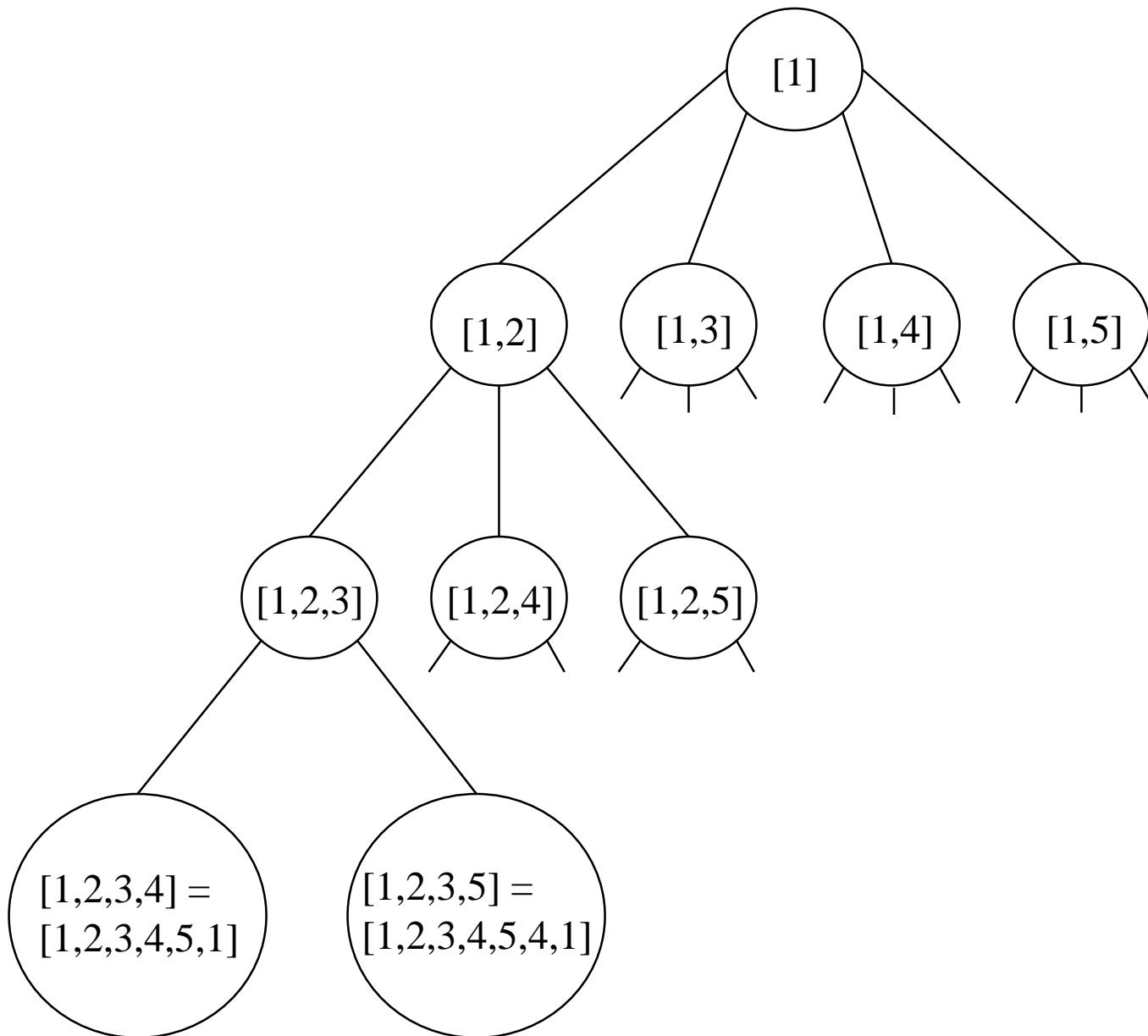
**Best-First Search** : the best bound at present is searched first

$$W = \begin{bmatrix} 0 & 14 & 4 & 10 & 20 \\ 14 & 0 & 7 & 8 & 7 \\ 4 & 5 & 0 & 7 & 16 \\ 11 & 7 & 9 & 0 & 2 \\ 18 & 7 & 17 & 4 & 0 \end{bmatrix}$$



# State Space Tree for TSP

- 각 마디는 출발마디로부터의 일주여행경로를 나타내게 되는데, 몇 개 만 예를 들어 보면, 뿌리마디의 여행경로는 [1]이 되고, 뿌리마디에서 뻗어 나가는 수준 1에 있는 여행경로는 각각 [1,2], [1,3], ..., [1,5]가 되고, 마디 [1,2]에서 뻗어 나가는 수준 2에 있는 마디들의 여행경로는 각각 [1,2,3], ..., [1,2,5]가 되고, 이런 식으로 뻗어 나가서 잎마디에 도달하게 되면 완전한 일주여행경로를 가지게 된다.
- 따라서 최적일주여행경로를 구하기 위해서는 잎마디에 있는 일주여행경로를 모두 검사하여 그 중에서 가장 길이가 짧은 일주여행경로를 찾으면 된다.
- 참고: 위 예에서 각 마디에 저장되어 있는 마디가 4개가 되면 더 이상 뻗어 나갈 필요가 없다. 왜냐하면, 남은 경로는 더 이상 뻗어 나가지 않고도 알 수 있기 때문이다.



# Best-Search with Branch\_and\_Bound

- 분기한정 가지치기로 최고우선 검색을 사용하기 위해서 각 마디의 한계치를 구할 수 있어야 한다. 이 문제에서는 주어진 마디에서 뻗어 나가서 얻을 수 있는 여행경로의 길이의 하한(최소치)을 구하여 한계치로 한다. 그리고 각 마디를 검색할 때 최소여행경로의 길이 보다 한계치가 작은 경우 그 마디는 유망하다고 한다. 최소여행경로의 초기값은  $\infty$ 로 놓는다. 따라서 완전한 여행경로를 처음 얻을 때 까지는 한계치가 무조건 최소여행경로의 길이 보다 작게 되므로 모든 마디는 유망하다.
- 각 마디의 한계치는 어떻게 구하나?

[1,...,k]의 여행경로를 가진 마디의 한계치는 다음과 같이 구한다. Let:

$$A = V - ([1, \dots, k] \text{ 경로에 속한 모든 마디의 집합})$$

bound = [1,...,k] 경로 상의 총거리

- +  $v_k$ 에서 A에 속한 정점으로 가는 이음선의 길이들 중에서 최소치
- +  $\sum_{i \in A} (v_i \text{에서 } A \cup \{v_1\} - \{v_i\} \text{에 속한 정점으로 가는 이음선의 길이들 중에서 최소치})$

# Computation of Bound for a Node

1. Starts at  $v_1$ , the 2nd vertex can be  $v_2, v_3, v_4, v_5$ .

$$v_1 : \min\{14, 4, 10, 20\} = 4 \quad v_2 : \min\{14, 7, 8, 7\} = 7$$

$$v_3 : \min\{4, 5, 7, 16\} = 4 \quad v_4 : \min\{11, 7, 9, 2\} = 2$$

$$v_5 : \min\{18, 7, 17, 4\} = 4$$

The minimum bound is 21.

There can be no tour with  
a shorter length.

2. Suppose we have visited  $[v_1, v_2]$

$$v_1 : 14$$

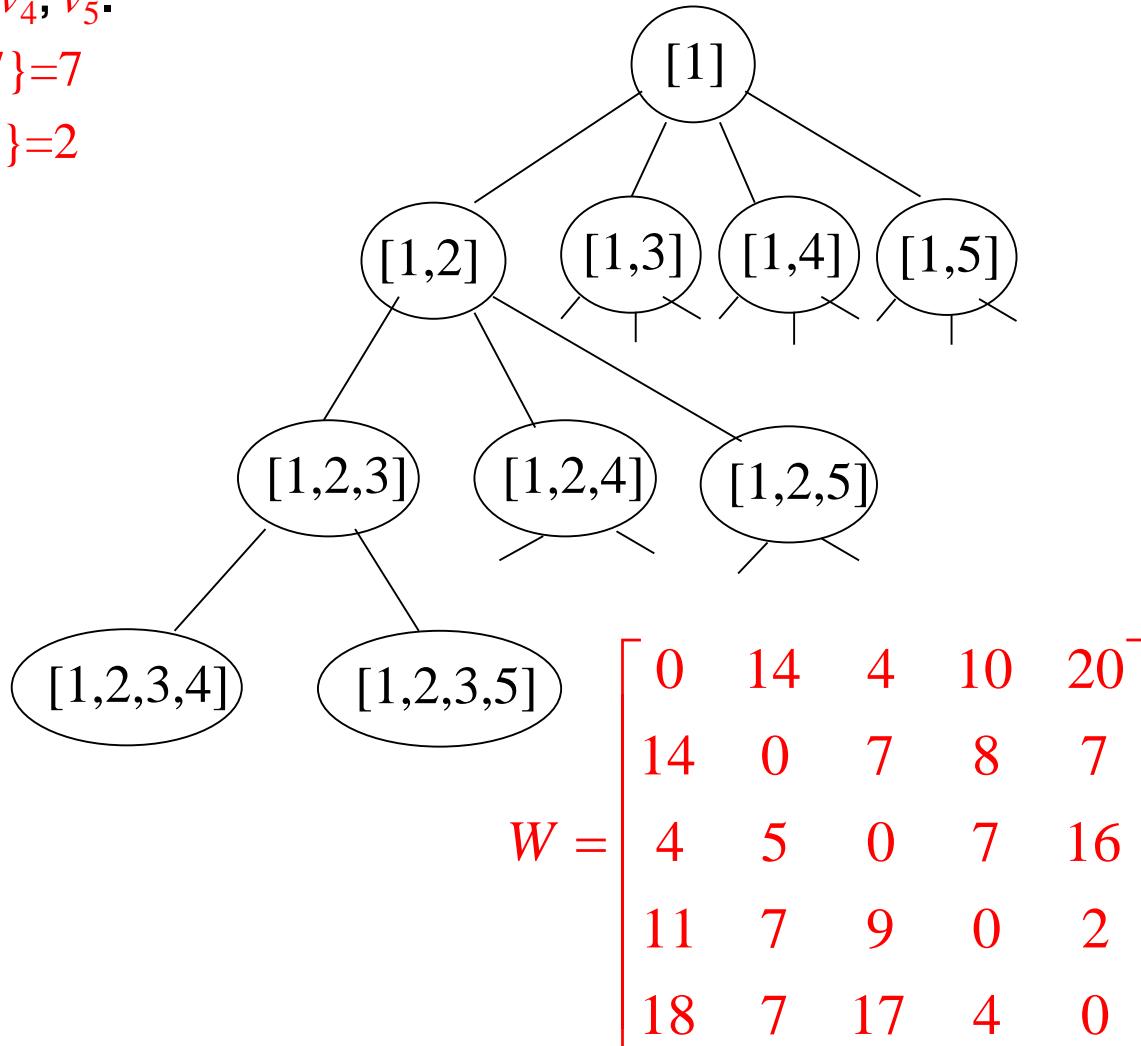
$$v_2 : \min\{7, 8, 7\} = 7$$

$$v_3 : \min\{4, 7, 16\} = 4$$

$$v_4 : \min\{11, 9, 2\} = 2$$

$$v_5 : \min\{18, 17, 4\} = 4$$

The minimum bound is 31.



## Example 6.3

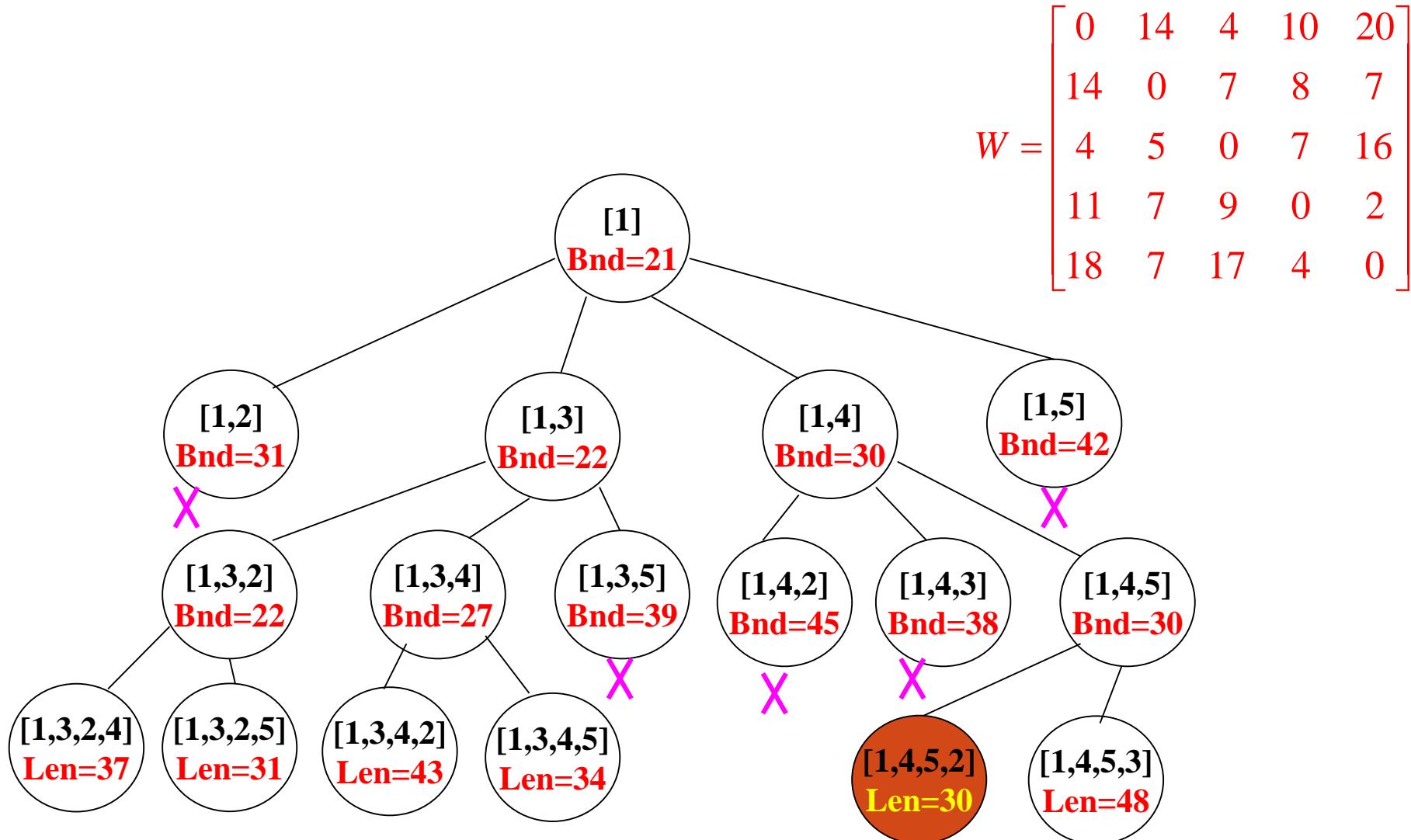
1. Visit node [1] : bound=21, minlength=∞
2. Visit node [1,2] : bound=31,
3. Visit node [1,3] : bound=22,
4. Visit node [1,4] : bound=30,
5. Visit node [1,5] : bound=42,
6. Visit node [1,3,2] : bound=22,
7. Visit node [1,3,4] : bound=27,
8. Visit node [1,3,5] : bound=39,
9. Visit node [1,3,2,4] : bound=37,  
minlength=37
10. Visit node [1,3,2,5] : bound=31,  
minlength=31

← Best First Search Node

← Best First Search Node

$$W = \begin{bmatrix} 0 & 14 & 4 & 10 & 20 \\ 14 & 0 & 7 & 8 & 7 \\ 4 & 5 & 0 & 7 & 16 \\ 11 & 7 & 9 & 0 & 2 \\ 18 & 7 & 17 & 4 & 0 \end{bmatrix}$$

## Example 6.3 (Cont'd)



## Algorithm 6.3

```
void travel2 (int n,
              const number W[][],
              ordered_set& opttour
              number& minlength)
{ priority_queue_of_node PQ;
  node u, v;
  initialize(PQ);
  v.level = 0;
  v.path = [1];
  v.bound = bound(v);
  minlength =  $\infty$ ;
  insert(PQ, v);
  while (!empty(PQ))
  { remove(PQ, v);
    if (v.bound < minlength)
    { v.level = v.level +1;
      for (all i such that  $2 \leq i \leq n$ 
            && i is not in v.path)
      { u.path = v.path;
        put i at the end of u.path;
        if (u.level == n-2)
        { put index of only vertex not
          in u.path at the end of u.path ;
          put 1 at the end of u.path ;
          if (length(u) < minlength)
          { minlength = length(u);
            opttour = u.path ; }
        }
      else
      { u.bound = bound(u);
        if (u.bound < minlength)
        insert(PQ, u);
      }
    }
  }
}
```

# Analysis

- 이 알고리즘은 방문하는 마디의 개수가 더 적다.
- 그러나 아직도 알고리즘의 시간복잡도는 지수적이거나 그보다 못하다!
- 다시 말해서  $n = 40$ 이 되면 문제를 풀 수 없는 것과 다름 없다고 할 수 있다.
- 다른 방법이 있을까?
  - 근사(approximation) 알고리즘: 최적의 해답을 준다는 보장은 없지만, 무리 없이 최적에 가까운 해답을 주는 알고리즘.