

Marcos Daniel V. Baroni

A Hybrid Heuristic for the Multi-objective Knapsack Problem

Vitória - Espírito Santo - Brasil
November 27, 2017

Marcos Daniel V. Baroni

A Hybrid Heuristic for the Multi-objective Knapsack Problem

Tese de Doutorado apresentada de acordo com o regimento do Programa de Pós-graduação em Informática da Universidade Federal do Espírito Santo.

Universidade Federal do Espírito Santo – UFES
Departamento de Informática
Programa de Pós-Graduação em Informática

Advisor: Dr. Flávio Miguel Varejão

Vitória - Espírito Santo - Brasil
November 27, 2017

Marcos Daniel V. Baroni

A Hybrid Heuristic for the Multi-objective Knapsack Problem

Tese de Doutorado apresentada de acordo com o regimento do Programa de Pós-graduação em Informática da Universidade Federal do Espírito Santo.

Work approved. Vitória - Espírito Santo - Brasil, November 27, 2017:

Dr. Flávio Miguel Varejão
Advisor

Dr.^a Maria Claudia Silva Boeres
Member

Dr. Arlindo Gomes de Alvarenga
Guest

Dr.^a Simone de Lima Martins
Guest

Vitória - Espírito Santo - Brasil
November 27, 2017

Resumo

Many real applications like project selection, capital budgeting and cutting stock involves optimizing multiple objectives that are usually conflicting and can be modelled as a multi-objective knapsack problem (MOKP). Unlike the single-objective case, the MOKP is considered a NP-Hard problem with considerable intractability. This work propose a hybrid heuristic for the MOKP based on the shuffled complex evolution algorithm. A multi-dimensional indexing strategy for handling large amount of intermediate solutions are proposed as an optimization, which yields considerable efficiency, especially on cases with more than two objectives. A series of computational experiments show the applicability of the proposal to several types of instances.

Keywords: Multi-objective Knapsack Problem, Metaheuristic, Shuffled Complex Evolution, Multi-dimensional indexing

Contents

1	Introdução	7
2	O Problema da Mochila Multi-objetivo	9
2.1	Métodos Exatos	11
2.1.1	As relações de dominância	12
2.1.2	Geração de conjuntos cobertura e independente	14
2.2	Detalhes de implementação	16
2.2.1	Ordem dos itens	16
2.2.2	Relações de dominância	16
2.2.3	Utilizando multiplas relações de dominância	20
2.3	Métodos Heurísticos	20
3	A k-d tree	21
4	Experimentos	23
5	Conclusão	25
	References	27

1 Introdução

Intro...

2 O Problema da Mochila Multi-objetivo

Em problemas reais é comum a existência de situações em que deseja-se otimizar mais de um objetivo os quais, geralmente, são conflitantes. Estes problemas são chamados multi-objetivos e tipicamente não possuem uma solução sendo a melhor em todos os objetivos, mas as possuem várias soluções de interesse chamadas *soluções eficientes*.

Um problema de otimização multi-objetivo com m objetivos pode ser descrito como uma função vetorial $f(x) = (f_1(x), \dots, f_p(x))$ para a qual deseja-se encontrar um vetor $x \in X$ que maximize simultaneamente as m funções objetivo. Formalmente:

$$\begin{aligned} \max f(x) &= (f_1(x), f_2(x), \dots, f_m(x)) \\ \text{sujeito a } x &\in X \end{aligned}$$

Definição 1 (Dominância, Eficiência e conjunto Pareto). *Considere um problema de otimização multi-objetivo. Diz-se que uma solução $x \in X$ domina uma solução $y \in X$, denotado por $\text{dom}(x, y)$ se, e somente se, x é ao menos tão boa quanto y em todos os objetivos e melhor que y em ao menos um dos objetivos. Formalmente:*

$$\text{dom}(x, y) = \begin{cases} \forall i \in \{1, 2, \dots, m\} : f_i(x) \geq f_i(y) \text{ e} \\ \exists j \in \{1, 2, \dots, m\} : f_j(x) > f_j(y) \end{cases}$$

Uma solução $x \in X$ é dita eficiente, denotado por $\text{eff}(x)$, se, e somente se, x não é dominada por nenhuma outra solução pertencente a X . Formalmente:

$$\text{eff}(x) \iff \nexists (y \in X \wedge \text{dom}(y, x))$$

O conjunto de todas as soluções eficientes de um problema multi-objetivo, denotado por $\text{Par}(X)$, é chamado de conjunto Pareto ou conjunto Pareto-ótimo. Formalmente:

$$\text{Par}(X) = \{x \in X \mid \text{eff}(x)\}$$

Resolver um problema multi-objetivo consiste em determinar seu conjunto Pareto. Este conceito foi primeiramente elaborado por Vilfredo Pareto em 1896, que enunciou a relação Pareto-Ótima que diz: “não é possível melhorar uma característica do problema sem piorar outra”, o que caracteriza a relação conflitante entre os objetivos na otimização multi-objetivo.

Na Figura 1a ilustra o conceito de dominância. A solução marcada domina todas as soluções existentes na área hachurada. As soluções em destacadas na Figura 1b formam um conjunto Pareto por dominarem sobre todas as outras soluções.

Um dos problemas multiobjetivos mais importantes da literatura é o problema da mochila multiobjetivo (MOKP). Muitas problemas reais podem ser modelados como uma

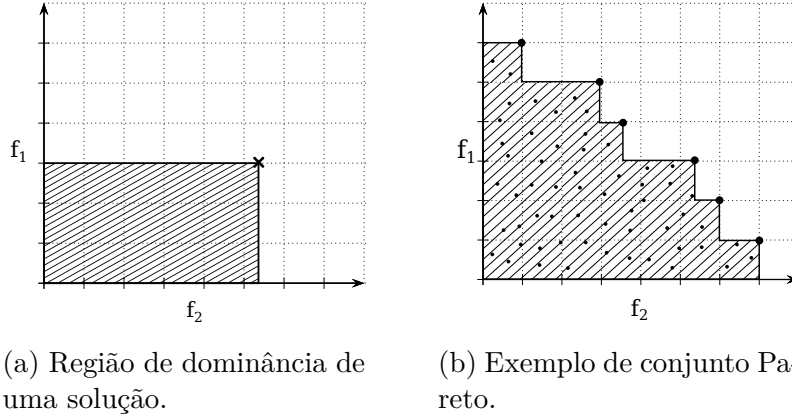


Figura 1: Exemplos de solução dominante e conjunto Pareto.

instância do MOKP como seleção de projetos (TENG; TZENG, 1996), orçamento de capital (ROSENBLATT; SINUANY-STERN, 1989), carregamento de carga (TENG; TZENG, 1996) e planejamento de estoque (ISHIBUCHI; AKEDO; NOJIMA, 2015).

Comentar sobre a dificuldade de problemas MObj. Exploação do pareto com o aumento da quantidade de objectivos. Poucos métodos extados eficientes, geralmente utiliza-se métodos heurísticos.

O problema da mochila multi-objetivo pode ser descrito como uma função vetorial f que mapeia uma variável de decisão (solução) a uma tupla de m valores (objetivos). Formalmente:

$$\begin{aligned} \max y = f(x) &= (f_1(x), f_2(x), \dots, f_m(x)) \\ \text{sujeito a } x &\in X \end{aligned}$$

onde x é a *variável de decisão*, X denota o conjunto de soluções viáveis e y representa o *vetor de objetivos* para os quais deseja-se maximizar.

Vale resaltar que o tamanho do conjunto Pareto para o problema em questão tende a crescer rapidamente com o tamanho do problema, especialmente com o número de objetivos.

Uma instância de um problema da mochila multi-objetivo (MOKP) com m objetivos consiste em uma capacidade inteira $W > 0$ e n itens. Cada item i possui um peso inteiro positivo w_i e m lucros inteiros $p_i^1, p_i^2, \dots, p_i^m$ não negativos. O lucro p_i^k representa a contribuição do i -ésimo item para com o k -ésimo objetivo. Uma solução é representada por um conjunto $x \subseteq \{1, \dots, n\}$ contendo os índices dos itens incluídos na mochila. Uma solução é viável se o peso total incluído na mochila não ultrapassa a capacidade da

mochila. Formalmente a definição do problema é a seguinte:

$$\begin{aligned} \max \quad & f(x) = (f_1(x), f_2(x), \dots, f_m(x)) \\ \text{subject to} \quad & w(x) \leq W \\ & x \in \{0, 1\}^n \end{aligned}$$

where

$$\begin{aligned} f_j(x) &= \sum_{i=1}^n p_i^j x_i \quad j = 1, \dots, m \\ w(x) &= \sum_{i=1}^n w_i x_i \end{aligned}$$

O MOKP é considerado um problema \mathcal{NP} -Hard visto set uma generalização do bem conhecido problema da mochila 0 – 1, para o qual $m = 1$. É consideravelmente difícil determinar o conjunto Pareto para um MOKP, especialmente para vários objetivos. Até mesmo para casos bi-objetivos, problemas pequenos podem se apresentar intratáveis. Por este motivo interessa-se no desenvolvimento de métodos eficientes para manipular uma grande quantidade de soluções, o que pode eventualmente trazer tratabilidade a instâncias antes intratáveis.

A literatura contém várias propostas para resolver o MOKP de forma exata. Porém, nenhum método tem provado ser eficiente para grande instâncias com mais de dois objetivos. Mesmo para problemas bi-objetivo, algumas instâncias de tamanho considerado médio têm aprestando dificuldades na determinação da solução exata, o que tem motivado o desenvolvimento de métodos heurísticas que buscam determinar um conjunto Pareto aproximado em tempo computacional razoável.

2.1 Métodos Exatos

Comentar sobre background de propostas de métodos exatos.

Comentar sobre o método da Bazgan como sendo considerado o melhor, citar melhorias propostas.

Explicar que o algoritmo Bazgan considera um conceito generalizado de dominância aplicado a cada iteração.

Dizer que a explicação do desenvolvimento do algoritmo será reproduzido segundo o artigo original.

Algorithm 1 O algoritmo de Nemhauser e Ullmann para o MOKP.

```

1: function DP( $\mathbf{p}, \mathbf{w}, W$ )
2:    $S^0 = \{\emptyset\}$ 
3:   for  $k \leftarrow 1, n$  do
4:      $S_*^k = S^{k-1} \cup \{x \cup k \mid x \in S^{k-1}\}$ 
5:     TODO...
6:   end for
7:    $P = \{x \mid \nexists a \in S^n : \underline{\triangle} ax \mid w(x) \leq W\}$ 
8:   return  $P$ 
9: end function

```

O processo sequencial executado pelo algoritmo de programação dinâmica consiste de n iterações. A cada k -ésima iteração é gerado o conjunto de estados S^k , que representa todas as soluções viáveis compostas de itens exclusivamente pertencentes aos k primeiros itens ($k = 1, \dots, n$). Um estado $s_k = (s_k^1, \dots, s_m^k, s_{m-1}^k) \in S_k$ representa uma solução viável que tem valor s_k^i como i -ésimo objetivo ($i = 1, \dots, m$) e s_k^{m-1} de peso. Portanto, temos $S_k = S_{k-1} \cup \{(s_{k-1}^1 + p_k^1)\}$

Comentar sobre as estratégias de redução dos conjuntos de estados, motivando as definições a seguir.

Definir conjunto cobertura, conjunto independente, conjunto eficiente reduzido, etc., definir parte simétrica/assimétrica de $\underline{\triangle}$?

Definição 2 (Extensão, Restrição e Complemento). *Considere o Algoritmo 1 e qualquer estado $s_k \in S_K$ ($k < n$). Um complemento de s_k é qualquer subconjunto $J \subseteq \{k+1, \dots, n\}$ tal que $s_k^{m+1} + \sum_{j \in J} w_j \leq W$. Assumiremos que qualquer estado $s_n \in S_n$ admite o conjunto vazio como único complemento. Um estado $s_n \in S_n$ é uma extensão de $s_k \in S_k$ ($k \leq n$) se, e somente se, existe um complemento I de s_k tal que $s_n^j = s_k^j + \sum_{i \in I} p_i^j$ para $j = 1, \dots, m$ e $s_n^{p+1} = s_k^{p+1} + \sum_{i \in I} w_i$. O conjunto de extensões de s_k é denotado por $Ext(s_k)$ ($k \leq n$). Um estado $s_k \in S_k$ ($k \leq n$) é uma restrição do estado $s_n \in S_n$ se, e somente se, s_n é uma extensão de s_k .*

2.1.1 As relações de dominância

Introdução às relações de dominância?

Definição 3 (Relação de dominância entre soluções). *Uma relação D_k sobre S_k , $k = i, \dots, n$, é uma relação de dominância se, e somente se, para todo $s_k, s_{k'} \in S_k$,*

$$s_k D_k s_{k'} \Rightarrow \forall s_{n'} \in Ext(s_{n'}), \exists s_n \in Ext(s_k), s_n \underline{\triangle} s_{n'} \quad (2.1)$$

Apesar das relações de dominância não serem transitivas por definição, costumam ser transitivas por construção, como é o caso das três relações de dominância da Seção 2.1.1. Vale notar que se D_k^i , $i = 1, \dots, p$ são relações de dominância então $D_k = \bigcup_{i=1}^p D_k^i$ é também uma relação de dominância, geralmente não transitiva mesmo se D_k^i , $i = 1, \dots, p$ forem transitivas.

Para se ter uma implementação eficiente do algoritmo de programação dinâmica é recomendável utilizar múltiplas relações de dominância D_k^1, \dots, D_k^p ($p \geq 1$) a cada execução da k -ésima iteração $k = 1, \dots, n$ uma vez que cada relação D_k^i explora características específicas.

Algorithm 2 Algoritmo de programação dinâmica utilizando múltiplas relações de dominância.

```

1: function DP
2:    $C^0 \leftarrow \{(0, \dots, 0)\}$ 
3:   for  $k \leftarrow 1, n$  do
4:      $C_k^0 \leftarrow C_{k-1} \cup \{(s_{k-1}^1 + p_k^1, \dots, s_{k-1}^m + p_k^m, s_{k-1}^{p+1} + w_k) \mid s_{k-1}^{p+1} + w_k \leq W, s_{k-1} \in C_{k-1}\}$ 
5:     for  $i \leftarrow 1, p$  do
6:       Determinar um conjunto  $C_k^i$  cobertura do conjunto  $C_{k-1}^i$  com respeito a  $D_k^i$ 
7:     end for
8:      $C_k \leftarrow C_k^p$ 
9:   end for
10:  return  $C_n$ 
11: end function

```

Proposição 1. Para quaisquer relações de dominância D_k^1, \dots, D_k^p ($p \geq 1$) sobre S_k , o conjunto C_k^p obtido pelo Algoritmo 2 em cada iteração é um conjunto cobertura de C_k^0 com respeito a $D_k = \bigcup_{i=1}^p D_k^i$ ($k = 1, \dots, n$).

Demonstração. Considere $s_k \in C_k^0 \setminus C_k^p$, este foi removido quando selecionado um conjunto cobertura na iteração da linha 5. Seja $i_1 \in \{1, \dots, p\}$ a iteração da linha 5, tal que $s_k \in C_k^{i_1-1} \setminus C_k^{i_1}$. Uma vez que $C_k^{i_1}$ é um conjunto cobertura de $C_k^{i_1-1}$ com respeito a $D_k^{i_1}$, existe $s_{k'}^{(1)} \in C_k^{i_1}$ tal que $s_{k'}^{(1)} D_k^{i_1} s_k$. Se $s_{k'}^{(1)} \in C_k^m$ então as propriedades de cobertura são válidas, uma vez que $D_k^{i_1} \subseteq D_k$. Caso contrário, existe uma iteração $i_2 > i_1$, correspondente à iteração da linha 5 tal que $s_{k'}^{(1)} \in C_k^{i_2-1} \setminus C_k^{i_2}$. Como anteriormente, estabelecemos que existe $s_{k'}^{(2)} \in C_k^{i_2}$ tal que $s_{k'}^{(2)} D_k^{i_2} s_{k'}^{(1)}$. Uma vez que $D_k^{i_2} \subseteq D_k$ temos que $s_{k'}^{(2)} D_k s_{k'}^{(1)} D_k s_k$ e por transitividade de D_k garantimos que $s_{k'}^{(2)} D_k s_k$. Pela repetição desse processo podemos garantir que a existência de um estado $s_{k'} \in C_k^m$, tal que $s_{k'} D_k s_k$. \square

Temos agora condições para garantir que o Algoritmo 2 gera o conjunto de vetores objetivos não dominados.

Teorema 1. *Para qualquer família de relações de dominância $D_k^i (i = 1, \dots, p; k = 1, \dots, n)$, o Algoritmo 2 retorna C_n que é um conjunto cobertura de S_n com respeito a $\underline{\Delta}$. Além disso, se na iteração n utilizarmos ao menos uma relação $D_n^i = \underline{\Delta}$ e garantirmos que o conjunto cobertura C_n^i é também independente com respeito a D_n^i então C_n representa o conjunto ND de vetores objetivos não dominados.*

Demonstração. Considere $s_{n'} \in S_n \setminus C_n$, todas as restrições foram removidas ao reter-se o conjunto cobertura com respeito a $D_k = \cup_{i=1}^m D_k^i$ durante as iterações $k \leq n$. Seja k_1 a iteração mais alta em que $C_{k_1}^0$ ainda contém restrições de $s_{n'}$, as quais serão removidas aplicando uma das relações $D_{k_1}^i (i = 1, \dots, p)$. Considere alguma destas restrições, denotada por $s_{k_1'}^{(n)}$. Uma vez que $s_{k_1'}^n \in C_{k_1}^0 \setminus C_{k_1}$ sabemos, pela Proposição 1, que existe $s_{k_1} \in C_{k_1}$ tal que $s_{k_1} D_{k_1} s_{k_1'}^{(n)}$. Pela Equação 2.1, uma vez que D_k é uma relação de dominância, temos que todas as extensões de $s_{k_1'}^{(n)}$, e particularmente para $s_{n'}$, existe $s_{n_1} \in Ext(s_{k_1})$ tal que $s_{n_1} \underline{\Delta} s_{n'}$. Se $s_{n_1} \in C_n$, então a propriedade de cobertura é válida. Caso contrário, existe uma iteração $k_2 > k_1$, correspondente a iteração mais alta em que $C_0^{k_2}$ ainda contém restrições de s_{n_1} , que serão removidas aplicando-se uma das relações $D_{k_2}^i (i = 1, \dots, p)$. Considere uma destas restrições, denotada por $s_{k_2'}^{(n_1)}$. Como anteriormente, estabelecemos a existência de um estado $s_{k_2} \in C_{k_2}$ tal que existe $s_{n_2} \in Ext(s_{k_2})$ tal que $s_{n_2} \underline{\Delta} s_{n_1}$. A transitividade de $\underline{\Delta}$ garante que $s_{n_2} \underline{\Delta} s_{n'}$. Pela repetição deste processo, estabelecemos a existência de um estado $s_{k_2} \in C_{k_2}$ tal que existe $s_{n_2} \in Ext(s_{k_2})$ tal que $s_{n_2} \underline{\Delta} s_{n'}$.

Além disso, selecionando-se um conjunto C_n^i que é conjunto independente com relação a $D_n^i = \underline{\Delta}$, esta propriedade se mantém válida para C_n^p o qual é subconjunto de C_n^i . Dessa forma C_n , que corresponde ao conjunto eficiente reduzido, representa o conjunto de vetores objetivos não dominados. \square

O teorema anterior apenas quer que um dos $n.p$ conjuntos coberturas seja independente com respeito a sua relação de dominância. Mesmo se todos os conjunto $C_k^i \dots$

2.1.2 Geração de conjuntos cobertura e independente

Apresentamos no Algoritmo 3 uma maneira de produzir C_k^i um conjunto cobertura e independente de C_k^{i-1} com respeito a relação transitiva D_k^i (linha ??? do Algoritmo 2).

Proposição 2. *Para qualquer relação de dominância D_k^i sobre S_k , o Algoritmo 3 retorna C_k^i um conjunto cobertura e independente de C_k^{i-1} com respeito a $D_k^i (j = 1, \dots, n; i = 1, \dots, p)$.*

Demonstração. Claramente C_k^i é independente com relação a D_k^i , uma vez que inserimos o estado s_k ao conjunto C_k^i na linha ??? apenas se não for dominado por nenhum outro estado em C_k^i (linha ???) e todos os estados dominados por s_k tenham sido removidos de C_k^i (linha ??? e ???).

Algorithm 3 Computação do conjunto C_k^i cobertura e independente do conjunto C_k^{i-1} com respeito a relação transitiva D_k^i .

```

1: function ( $C_k^{i-1} = \{s_{k(1)}, \dots, s_{k(r)}\}$ )
2:    $C_k^i \leftarrow \{s_{k(1)}\}$ 
3:   for  $h \leftarrow 2, r$  do
4:     Seja  $C_k^i = \{s_{k'(1)}, \dots, s_{k'(l_h)}\}$ 
5:      $dominated \leftarrow false$ ;
6:      $dominates \leftarrow false$ ;
7:      $j \leftarrow 1$ ;
8:     while  $j \leq l_h$  and  $\neg dominated$  and  $\neg dominates$  do
9:       if  $s_{k'(j)} D_k^i s_{k(h)}$  then
10:         $dominated \leftarrow true$ ;
11:       else if  $s_{k(h)} D_k^i s_{k'(j)}$  then
12:         $C_k^i \leftarrow C_k^i \setminus \{s_{k'(j)}\}$ ;
13:         $dominates \leftarrow true$ ;
14:       end if
15:        $j \leftarrow j + 1$ ;
16:     end while
17:     if  $\neg dominated$  then
18:       while  $j \leq l_h$  do
19:         if  $s_{k(h)} D_k^i s_{k'(j)}$  then
20:           $C_k^i \leftarrow C_k^i \setminus \{s_{k'(j)}\}$ ;
21:         end if
22:          $j \leftarrow j + 1$ ;
23:       end while
24:        $C_k^i \leftarrow C_k^i \cup \{s_{k(h)}\}$ ;
25:     end if
26:   end for
27:   return  $C_k^i$ 
28: end function

```

Mostramos agora que C_k^i é um conjunto cobertura de C_k^{i-1} com respeito a D_k^i . Considere $s_{k'} \in C_k^{i-1} \setminus C_k^i$. Isto ocorre tanto porque não passa no teste da linha ??? quanto porque foi removido na linha ??? ou ???. Isto é devido respectivamente a um estado s_{-k} já existente em C_k^i ou a ser incluído em C_k^i (na linha ???) tal que $s_{-k} D_k^i s_{k'}$. Pode ser que s_{-k} seja removido de C_k^i em uma iteração posterior da linha ??? se existir um novo estado $s_{\hat{k}} \in C_k^{i-1}$ a ser incluído em C_k^i , tal que $s_{\hat{k}} D_k^i s_{-k}$. Entretanto, a transitividade de D_k^i garante a existência, ao fim da iteração k , de um estado $s_k \in C_k^i$ tal que $s_k D_k^i s_{k'}$. \square

O Algoritmo 3 pode ser aprimorado uma vez que geralmente é possível gerar estados de $C_k^{i-1} = \{s_{k(1)}, \dots, s_{k(r)}\}$ conforme uma *ordem de preservação de dominância* para D_k^i de forma que todo $l < j$ ($1 \leq l, j \leq r$) temos tanto $s_{k(l)} D_k^i s_{k(j)}$ ou $\neg(s_{k(j)} D_k^i s_{k(l)})$. A proposição seguinte provê a condição necessária e suficiente para estabelecer a existência da ordem de preservação de dominância para uma relação de dominância.

Proposição 3. *Seja D_k uma relação de dominância sobre S_k . Existe uma ordem de*

preservação de dominância para D_k se, e somente se, D_k não admite ciclos em sua parte assimétrica.

Demonstração.

\Rightarrow A existência de um ciclo na parte assimétrica de D^k implicaria na existência de dois estados consecutivos $s_{k(j)}$ e $s_{k(l)}$ neste ciclo sendo $j > l$, o que é uma contradição.

\Leftarrow Qualquer ordem topológica baseada na parte assimétrica de D_k é uma ordem de preservação de dominância para D_k . \square

Na Seção seguinte é apresentado um exemplo de ordem de preservação de dominância. Se os estados em C_k^{i-1} são gerados conforme uma ordem de preservação de dominância para D_k^i , a linha ??? e o laço ???-??? do Algoritmo 3 podem ser omitidos.

2.2 Detalhes de implementação

Primeiramente é apresentada a ordem na qual serão considerados os itens no processo sequencial do algoritmo. Posteriormente são apresentados a três relações de dominância utilizadas no algoritmo ??? e a maneira com que serão utilizadas.

2.2.1 Ordem dos itens

A ordem na qual os itens são considerados é uma questão crucial na implementação do algoritmo. Sabe-se que no caso do problema da mochila unidimensional, para se obter uma boa solução, os itens devem ser geralmente considerados em ordem decrescente segundo a proporção p_i/w_i (EHRGOTT, 2013; MARTELLO; TOTH, 1990). Porém, para o caso multi-objetivo não existe uma ordem natural.

São introduzidas duas ordenações \mathcal{O}^{sum} e \mathcal{O}^{max} derivadas da agregação das ordens \mathcal{O}^j inferidas pelas proporções p_i^j/w_i para cada objetivo ($j = 1, \dots, m$). Considere r_i^l o rank (ou posição) do item l na ordenação \mathcal{O}^j . \mathcal{O}^{sum} denota uma ordenação segundo valores crescentes da soma dos ranks dos itens nas m ordenações ($i = 1, \dots, m$). \mathcal{O}^{max} denota uma ordenação segundo valores crescentes de máximo ou piores ranks de itens nas m ordenações \mathcal{O}^j ($j = 1, \dots, m$), onde o pior rank do item l nas m ordenações \mathcal{O}^j ($j = 1, \dots, m$) é calculado como $\max_{i=1}^m \{r_l^i\} + \frac{1}{mn} \sum_{i=1}^m r_l^i$ para distinguir itens com o mesmo rank máximo.

Dizer que o artigo original conclui através de testes qual é a melhor ordenação para ser utilizada nas iterações do algoritmo.

2.2.2 Relações de dominância

Cada relação de dominância expõe uma consideração específica. Por isto recomenda-se utilizar relações de dominância que sejam complementares. Além disso, para se escolher

uma relação de dominância é necessário considerar sua potencial capacidade de descarte de estados diante do custo computacional requerido.

A seguir serão apresentadas as três relações de dominância utilizadas no algoritmo. As primeiras duas relações são razoavelmente triviais de se estabelecer sendo a última ainda considerada, mesmo sendo um tanto mais complexa, devido à sua complementaridade diantes das duas primeiras.

A primeira relação de dominância se estabelece segundo a seguinte observação. Quando a capacidade residual de uma solução associada a um estado s_k da iteração k é maior ou igual a soma dos pesos dos itens restantes, i.e. itens $k+1, \dots, n$, o único complemento de s_k que pode resultar em uma solução eficiente é o complemento máximo $I = \{k+1, \dots, n\}$. Portanto, neste contexto, não se faz necessário gerar as extensões de s_k que não contemham todos os itens restantes. Define-se então a relação de dominância D_k^r sobre S^k para $k = 1, \dots, n$ como:

$$\forall s_k, s_{k'} \in S_k, \quad s_k D_k^r s_{k'} \Leftrightarrow \begin{cases} s_{k'} \in S_{k-1}, \\ s_k = (s_{k'}^1 + p_k^1, \dots, s_{k'}^m + p_k^m, s_{k'}^{m+1} + w_k), \text{ e} \\ s_{k'}^{m+1} \leq W - \sum_{i=k}^n w_i \end{cases}$$

A seguinte proposição mostra que D_k^r é de fato uma relação de dominância e apresenta propriedades adicionais de D_k^r .

Proposição 4 (Relação D_k^r).

- (a) D_k^r é uma relação de dominância
- (b) D_k^r é transitiva
- (c) D_k^r admite ordem de preservação de dominância

Demonstração.

- (a) Considere dois estados s_k e $s_{k'}$ tal que $s_k D_k^r s_{k'}$. Isto implica que $s_k \trianglelefteq s_{k'}$. Além disso, uma vez que $s_k^{m+1} = s_{k'}^{m+1} + w_k \leq W - \sum_{i=k+1}^n w_i$, qualquer subconjunto $I \subseteq \{k+1, \dots, n\}$ é um complemento de $s_{k'}$ e s_k . Portanto, para todo estado $s_{n'} \in \text{Ext}(s_{k'})$, existe $s_n \in \text{Ext}(s_k)$, baseado no mesmo complemento que $s_{n'}$, tal que $s_n \trianglelefteq s_{n'}$. Isto estabelece que D_k^r satisfaz a Equação 2.1 da Definição 3.

- (b) Trivial.

- (c) Pela Proposição 3, uma vez que D_k^r é transitiva. □

Esta relação de dominância é um tanto fraca, uma vez que em cada k -ésima iteração ela pode apenas..... Apesar disso, é uma relação de dominância extremamente fácil de ser verificada, uma vez que, ao ser o valor de $W - \sum_{i=k}^n$ computado, a relação D_k^r requer apenas uma comparação para ser estabelecida entre dois estados.

A relação de dominância seguinte é a generalização para o caso multi-objetivo da relação de dominância proposta por Weingartner e Ness (??) e utilizada no clássico algoritmo de Nemhauser e Ulmann (??). Esta segunda relação de dominância é definida sobre s_k para $k = 1, \dots, n$ por:

$$\forall s_k, s_{k'} \in S_k, s_k D_k^{\triangle} s_{k'} \Leftrightarrow \begin{cases} s_k \triangle s_{k'} & \text{e} \\ s_k^{m+1} \leq s_{k'}^{m+1} & \text{se } k < n \end{cases}$$

Observe que a condição sobre os pesos s_k^{m+1} e $s_{k'}^{m+1}$ garante que todo complemento de $s_{k'}$ é também um complemento de s_k . A seguinte proposição mostra que D_k^{\triangle} é de fato uma relação de dominância e apresenta propriedades adicionais de D_k^{\triangle} .

Proposição 5 (Relação D_k^r).

- (a) D_k^{\triangle} é uma relação de dominância
- (b) D_k^{\triangle} é transitiva
- (c) D_k^{\triangle} admite ordem de preservação de dominância
- (c) $D_n^{\triangle} = \underline{\triangle}$

Demonstração.

- (a) TODO....
- (b) Trivial.
- (c) Pela Proposição 3, uma vez que D_k^{\triangle} é transitiva.
- (d) Por definição. □

A terceira relação de dominância é baseada na comparação entre extensões específicas de um estado e um limite superior de extensões de outros estados. Um limite superior de um estado é definido segundo no contexto a seguir.

Definição 4 (Limite superior). *Um vetor objetivo $u = (u^1, \dots, u^m)$ é um limite superior de um estado $s_k \in S_k$ se, e somente se, $\forall s_n \in \text{Ext}(s_k)$ tem-se que $u^i \geq s_n^i, i = 1, \dots, m$.*

Um tipo geral de relação de dominância pode ser derivada da seguinte maneira: considere dois estados $s_k, s_{k'} \in S_k$, se existe um complemento I de s_k e um limite superior \tilde{u} de $s_{k'}$ tal que $s_k^j + \sum_{i \in I} p_i^j \geq \tilde{u}^j, j = 1, \dots, m$, então s_k domina $s_{k'}$.

Este tipo de relação de dominância pode ser implementada apenas para complementos específicos e limites superiores. Na implementação do algoritmo em questão são apenas considerados dois complementos específicos I' e I'' obtidos pelo simples algoritmo de preenchimento guloso definido a seguir. Após rerotular os itens $k + 1, \dots, m$ de acordo

com a ordenação \mathcal{O}^{sum} (e \mathcal{O}^{max} respectivamente), o complemento I' (e I'' respectivamente) são obtidos através a inserção sequencial dos itens restantes na respectiva solução de forma que a restrição de capacidade é respeitada.

Para computar u , utiliza-se o limite inferior proposto em (MARTELLO; TOTH, 1990) para cada valor de objetivo. Considere $\overline{W}(s_k) = W - s_k^{m+1}$ a capacidade residual associada ao estado $s_k \in S_k$. Denota-se por $c_j = \min\{l_j \in \{k_1, \dots, n\} \mid \sum_{i=k+1}^{l_j} w_i > \overline{W}(s_k)\}$ a posição do primeiro item que não pode ser adicionado ao estado $s_k \in S_k$ quando os itens $k+1, \dots, n$ são rerotulados de acordo com a ordenação \mathcal{O}^j . Desde modo, segundo (MARTELLO; TOTH, 1990), quando os itens $k+1, \dots, n$ são rerotulados de acordo com a ordenação \mathcal{O}^j , um limite inferior para o j -ésimo valor objetivo de $s_k \in S_k$ é para $j = 1, \dots, m$:

$$u^j = s_k^j + \sum_{i=k+1}^{c_j-1} p_i^j + \max \left\{ \left\lfloor \overline{W}(s_k) \frac{p_{c_j+1}^j}{w_{c_j+1}} \right\rfloor, \left\lfloor p_{c_j}^j - (w_{c_j} - \overline{W}(s_k)) \cdot \frac{p_{c_j-1}^j}{w_{c_j-1}} \right\rfloor \right\} \quad (2.2)$$

Finalmente definimos D_k^b uma relação de dominância como caso particular do tipo geral para $k = 1, \dots, n$ por:

$$\forall s_k, s_{k'} \in S_k, s_k D_k^b s_{k'} \Leftrightarrow \begin{cases} s_k^j + \sum_{i \in I'} p_i^j \geq \tilde{u}^i, & j = 1, \dots, m \\ \text{ou} \\ s_k^j + \sum_{i \in I''} p_i^j \geq \tilde{u}^i, & j = 1, \dots, m \end{cases}$$

onde $\tilde{u} = (\tilde{u}_1, \dots, \tilde{u}_m)$ é o limite superior para $s_{k'}$ computado de acordo com a Equação 2.2.

A seguinte proposição mostra que D_k^b é de fato uma relação de dominância e apresenta propriedades adicionais de D_k^b .

Proposição 6 (Relação D_k^b).

- (a) D_k^b é uma relação de dominância
- (b) D_k^b é transitiva
- (c) D_k^b admite ordem de preservação de dominância
- (c) $D_n^b = \underline{\Delta}$

Demonstração.

- (a) Considere os estados s_k e $s_{k'}$ tal que $s_k D_k^b s_{k'}$. Isto implica que existe $I \in I', I''$ que capaz de gerar um estado $s_n \in Ext(s_{k'})$. Além disso, uma vez que \tilde{u} é um limite superior de $s_{k'}$, temos $\tilde{u} \underline{\Delta} s_{n'}, \forall s_{n'} \in Ext(s_{k'})$. Portanto, por transitividade de $\underline{\Delta}$, temos que $s_n \underline{\Delta} s_{n'}$, o que estabelece que D_k^b satisfaz a condição da Equação 2.1 da Definição 3.

- (b) Considere os estados $s_k, s_{k'}$ e s_{-k} tal que $s_k D_k^b s_{k'}$ e $s_{k'} D_k^b s_{-k}$. Isto implica que, por um lado, existe $I_1 \in \{I', I''\}$ tal que $s_k^j + \sum_{i \in I_1} p_i^j \geq \tilde{u}_j (j = 1, \dots, m)$ por outro lado, existe $I_2 \in \{I', I''\}$ tal que $s_{k'}^j + \sum_{i \in I_2} p_i^j \geq \bar{u}_j (j = 1, \dots, m)$ Uma vez que \tilde{u} é um limite superior para $s_{\tilde{k}}$ temos que $\tilde{u}_j \geq s_{k'}^j + \sum_{i \in J_2} p_i^j (i = 1, \dots, m)$. Portanto temos que $s_k D_k^b s_{-k}$.
- (c) Pela Proposição 3, uma vez que D_k^b é transitiva.
- (d) Por definição. □

A relação D_k^b é mais difícil de ser verificada do que as relações D_k^r e D_k^Δ uma vez que requer uma maior quantidade de comparações e informações sobre outros estados.

Obviamente, a relação D_k^b seria mais forte se utilizados complementos adicionais (de acordo com outras ordenações) para s_k e computado, ao invés de apenas um limite superior u , um conjunto de limites superiores, como por exemplo, a proposta apresentada em (??). Porém, no contexto em questão, uma vez que temos que verificar D_k^b para muitos estados, enriquecer D_k^b dessa forma demandaria um esforço computacional alto demais.

2.2.3 Utilizando multiplas relações de dominância

Para se ter uma implementação eficiente, são utilizadas as três relações de dominância apresentadas na Seção 2.2.2 em cada iteração.

2.3 Métodos Heurísticos

3 A k-d tree

4 Experimentos

5 Conclusão

References

EHRGOTT, M. *Multicriteria optimization*. [S.l.]: Springer Science & Business Media, 2013.

ISHIBUCHI, H.; AKEDO, N.; NOJIMA, Y. Behavior of multiobjective evolutionary algorithms on many-objective knapsack problems. *IEEE Transactions on Evolutionary Computation*, IEEE, v. 19, n. 2, p. 264–283, 2015.

MARTELLO, S.; TOTH, P. *Knapsack Problems, J.* [S.l.]: Wiley & Sons, Chichester, 1990.

ROSENBLATT, M. J.; SINUANY-STERN, Z. Generating the discrete efficient frontier to the capital budgeting problem. *Operations Research*, INFORMS, v. 37, n. 3, p. 384–394, 1989.

TENG, J.-Y.; TZENG, G.-H. A multiobjective programming approach for selecting non-independent transportation investment alternatives. *Transportation Research Part B: Methodological*, Elsevier, v. 30, n. 4, p. 291–307, 1996.