UNIVERSIDADE FEDERAL DO RIO GRANDE DO SUL

INSTITUTO DE INFORMÁTICA

PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM COMPUTAÇÃO

FELIPE ZORZO PEREIRA

Simulated Annealing para o Problema dos Grupos Balanceados de Maior Valor

Projeto apresentado com o objetivo de melhor entender a meta-heurística Simulated Annealing por meio de testes sobre o problema dos grupos balanceados de maior valor.

Orientador: Prof. Dr. Marcus Ritt

Porto Alegre

2018

**SUMÁRIO**

1 INTRODUÇÃO 3

2 FORMULAÇÃO DO PROGRAMA INTEIRO 4

3 PARÂMETROS 5

4 ALGORITMO 6

4.1 Representação de uma solução 6

4.2 Solução inicial 7

4.3 Vizinhança 7

4.4 Temperatura inicial 7

4.5 Critério de parada 7

4.6 Entradas da instância do problema 8

5 IMPLEMENTAÇÃO 9

5.1 Plataforma de implementação 9

5.2 Estruturas de dados utilizadas 9

5.3 Impossibilidade de criar um vizinho 9

6 TESTES DE PARÂMETROS 10

6.1 Teste dofatorde resfriamento (parâmetro *r*) 10

6.2 Teste do número de vizinhos gerados por temperatura (parâmetro *I*) 11

6.3 Teste da probabilidade inicial (parâmetro *pi*) 12

6.4 Teste da probabilidade final (parâmetro *pf*) 13

6.5 Teste do número de trocas da vizinhança (parâmetro *k*) 14

6.6 Teste do número desoluções iniciais geradas (parâmetro *nsi*) 15

7 TESTES Das instâncias 17

3.2 Citação Direta 9

4 CONCLUSÃO 18

referências 19

1 INTRODUÇÃO

O objetivo deste trabalho foi analisar os resultados obtidos pela aplicação de uma meta-heurística ao problema dos grupos balanceados de maior valor. A meta-heurística escolhida foi o Simulated Annealing, cujos detalhes serão minuciados nas próximas seções.

A definição do problema dos grupos balanceados de maior valor é: dado um grafo não-direcionado G = (V, A) com valor du,v ≥ 0 da aresta entre os vértices u,v V, pesos pv para cada vértice v V, g grupos com limites L (inferior) e U (superior) para o peso total do grupo, maximiza o valor total das arestas entre vértices do mesmo grupo.

2 FORMULAÇÃO DO PROGRAMA INTEIRO

**Variáveis:** A variável xi,j é igual a 1 se vértice i [n] está no grupo j [g]; caso contrário, xi,j é igual 0. A variável ci,k,j, por sua vez, é igual a 1 se vértices i [n] e k [n] estão no grupo j [g]; caso contrário, é igual a 0. A letra g denota o número de grupos da instância do problema, enquanto n o número de vértices.

**Função Objetivo:**

**Restrições:**

A restrição (1) garante que o peso de cada grupo não ultrapasse o seu limite superior; da mesma forma, a restrição (2) garante que o peso de cada grupo não seja menor que seu limite inferior.

A restrição (3) faz com que cada vértice esteja no máximo em um grupo.

A restrição (4) obriga ci,k,j a seguir sua definição: ela só poderá ser igual a 1 se tanto o vértice i [n] quanto o vértice k [n] estiverem no grupo j.

Ressalta-se que pi denota o peso do vértice i [n], Lj e Uj o peso total mínimo e máximo, respectivamente, do grupo j [g] e di,k o valor da aresta entre os vértices i [n] e k [n]. Caso não exista aresta entre tais vértices, considera-se que di,k = 0.

3 PARÂMETROS DO SIMULATED ANNEALING

*r*:fator de resfriamento do algoritmo, número real entre 0 e 1.

*I*: número de vizinhos gerados em uma mesma temperatura do algoritmo, inteiro maior ou igual a 1.

*k*: número de trocas a serem realizados pelo k-change durante a criação de um vizinho, inteiro maior ou igual a 1.

*pf:* probabilidade final, número real entre 0 e 1. Probabilidade mínima desejada de se realizar um movimento para um vizinho pior.

*pi:* probabilidade inicial, número real entre 0 e 1. Probabilidade desejada de o algoritmo realizar um movimento para um vizinho pior durante sua temperatura inicial.

*nsi:* número de soluções iniciais geradas antes de passar a melhor delas para o Simulated Annealing, número inteiro maior ou igual a 1.

4 O ALGORITMO



4.1 Representação de uma solução

É representada por uma lista de listas. Cada uma das listas representa um grupo da instância do problema; cada elemento da lista será o índice de um dos vértices que está no grupo representado por esta lista.

4.2 Solução inicial

É feita de forma aleatória. Adiciona-se vértices aleatórios da instância do problema a um grupo até que o peso desse grupo seja maior ou igual a seu limite inferior. Após este passo ser realizado para todos os grupos, se ainda há vértices sem grupo, eles são adicionados a algum. Após todos os vértices terem sido adicionados a um grupo, a solução é testada para confirmar sua factibilidade. Se é factível, a solução é retornada; caso contrário, a distribuição de vértices é feita novamente. O algoritmo tenta criar uma solução inicial por um número fixo de iterações (500); se tal número é extrapolado, o Simulated Annealing é cancelado e retorna uma mensagem de erro.

4.3 Vizinhança

A vizinhança implementada foi a k-change. Cada vez que um novo vizinho é gerado, k vértices aleatórios são mudados de grupo. Se as mudanças gerarem uma solução factível, ela é retornada; caso contrário, o processo se repete por um número fixo de iterações (1000). Caso um vizinho factível não seja criado ao fim das iterações, a solução que tentava-se perturbar é retornada.

4.4 Temperatura inicial

O próprio Simulated Annealing é executado para encontrar uma temperatura inicial que aceite um movimento para um vizinho pior com probabilidade próxima à probabilidade inicial definida.

4.5 Critério de parada

O critério é definido pela probabilidade final utilizada. Quando, durante dez temperaturas seguidas (contadas pela variável *counter*), realizar um movimento para um vizinho pior ocorreu com probabilidade menor que a probabilidade final, o algoritmo é considerado resfriado e, portanto, parado.

4.6 Entradas da instância do problema

Além dos parâmetros do Simulated Annealing em si, descritos na seção 3, o algoritmo também recebe algumas entradas decorrentes do problema a ser resolvido:

*A:* valores das arestas entre os vértices.

*L:* limites inferiores do peso dos grupos.

*U:* limites superiores do peso dos grupos.

*p:* pesos dos vértices.

*n:* número de vértices.

*g:* número de grupos.

**5 IMPLEMENTAÇÃO**

5.1 Plataforma de implementação

O algoritmo foi implementado e testado em uma máquina com sistema operacional Windows 10 Enterprise (64-bit), 16GB de memória principal e processador Intel(R) Core(TM) i7-7700K com 4 núcleos físicos de 4.2GHz, cada um com 32KB de cache L1 e 256KB de cache L2. A linguagem de programação utilizada foi Python 3.6.3.

5.2 Estruturas de dados utilizadas

Para representar as arestas existentes entre vértices optou-se por utilizar uma matriz de adjacência não-espelhada.

Os limites inferiores e superiores são armazenados em listas. O elemento de índice j dessas listas contém o limite inferior/superior do grupo de índice j.

Os pesos dos vértices, assim como os limites, são armazenados em uma lista. O elemento de índice i contém o peso do vértice de índice i. L2.

5.3 Impossibilidade de criar um vizinho

Caso a criação de vizinhos não consiga gerar um vizinho factível para uma solução, retorna essa solução sem qualquer alteração, como já citado. Isso faz com que *delta* seja igual a 0 e que, consequentemente, o contador utilizado para definir quando o algoritmo deve ser parado seja zerado. Esse comportamento é indesejado, uma vez que o algoritmo poderia ficar preso em uma solução sem vizinhos.

Para solucionar esse problema, optou-se por, quando o vizinho devolvido for igual à solução atual, pôr um valor negativo em *delta* e fazer *exponent* tender a menos infinito. Isso garante que *counter* não seja zerado e que a taxa de aceitação de movimentos ruins decaia. Com isso, se uma solução não tiver vizinhos factíveis, a taxa de aceitação de movimentos ruins decai até ser menor que a probabilidade final; isso se repete durante as próximas nove temperaturas. O algoritmo é, então, parado. os.

6 TESTES DE PARÂMETROS

Para os seguintes testes, variou-se cada parâmetro de entrada separadamente, para determinar qual o valor ideal de cada um. Os valores padrão para os parâmetros que não estavam sendo testados são como segue: *r* = 0.99; *I* = 2500; *pf* = 0.05; *pi* = 0.85; *nsi* = 10000; *k* = 1.

Cada um dos parâmetros foi testado para a instância gbmv240\_01 e cada teste foi rodado três vezes, utilizando sementes aleatórias. O tempo de execução de cada teste foi medido. Fez-se média simples dos valores da solução final e do tempo de execução de cada teste.

6.1 Teste do fator de resfriamento (parâmetro *r*)

Os valores testados de *r* foram 0.99, 0.95 e 0.90. As figuras 6.1.1 e 6.1.2 mostram os resultados obtidos.

Figura 6.1.1 – Valor da solução encontrada em relação à variação do fator de resfriamento

Figura 6.1.2 – Tempo de execução em relação à variação do fator de resfriamento

Observa-se que o valor da solução final aumenta de maneira quase linear conforme o fator de resfriamento é aumentado. O tempo de execução quase dobra ao passar de *r* = 0.90 para *r* = 0.95 e, ao utilizar 0.99 como o valor de *r*, o tempo de execução aumenta drasticamente.

Apesar do aumento no tempo de execução, conclui-se que é aceitável utilizar *r* próximo a 1, devido ao aumento da qualidade da solução final.

6.2 Teste do número de vizinhos gerados por temperatura (parâmetro *I*)

Testou-se *I* com os valores 50, 250, 500, 1000 e 2500. As figuras 6.2.1 e 6.2.2 mostram os resultados.

Figura 6.2.1 – Valor da solução encontrada em relação à variação de *I*

Figura 6.2.2 – Tempo de execução em relação à variação de *I*

Este parâmetro é o que traz as maiores melhorias quanto ao valor absoluto da solução final encontrada. Observa-se que o valor da solução final cresce de forma logarítmica com o aumento do número de vizinhos por temperatura.

Essa melhoria trouxe consigo um impacto negativo no tempo de execução do algoritmo, que aumenta linearmente. Conclui-se, então, que *I* = 2500 é um valor satisfatório, uma vez que garante uma melhoria significativa no valor da solução final sem impactar de forma muito negativa o tempo de execução.

6.3 Teste da probabilidade inicial (parâmetro *pi*)

Para este parâmetro foram realizados quatro testes. Os valores testados foram 0.85, 0.90, 0.95 e 1. As figuras 6.3.1 e 6.3.2 demonstram os resultados atingidos.

Figura 6.3.1 – Valor da solução encontrada em relação à variação de *pi*

Figura 6.3.2 – Tempo de execução em relação à variação de *pi*

Conforme *pi* aumenta, os valores das soluções finais variam de forma não-uniforme: em um momento o valor melhora, no outro piora. O tempo de execução, por sua vez, apresenta leves aumentos quando *pi* aumenta; a exceção é quando se passa de *pi* = 0.95 para *pi* = 1, em que o tempo de execução mais de dobra.

Desta forma, conclui-se que o valor ideal da probabilidade inicial é 0.95, pois o tempo de execução não aumenta muito em relação a probabilidades iniciais menores, mas o valor da solução final é maior.

6.4 Teste da probabilidade final (parâmetro *pf*)

Testou-se a probabilidade final com os valores 0.01, 0.05, 0.10 e 0.15. As figuras 6.4.1 e 6.4.2 mostram os resultados.

Figura 6.4.1 – Valor da solução encontrada em relação à variação de *pf*

Figura 6.4.2 – Tempo de execução em relação à variação de *pf*

Observou-se que, quanto maior a probabilidade final, menores os valores, com exceção ao valor da solução final encontrada por *pf* = 0.15, que é maior que o valor da solução encontrada por *pf* = 0.10. Os tempos de execução, por outro lado, se mostram pouco variáveis.

Analisando os resultados, conclui-se que o ideal é escolher para a probabilidade final um valor próximo de 0, já que esta praticamente não influi no tempo gasto, mas melhora os valores das soluções finais.

6.5 Teste do número de trocas da vizinhança (parâmetro *k*)

Testou-se *k* com os valores 1, 2 e 4. As figuras 6.5.1 e 6.5.2 mostram os resultados.

Figura 6.5.1 – Valor da solução encontrada em relação à variação de *k*

Figura 6.5.2 – Tempo de execução em relação à variação de *k*

Alterações neste parâmetro levaram o algoritmo a atingir um valor de 210.000 para a instância gbmv240\_01 pela primeira vez, se mostrando bastante significativo.

Observou-se que, conforme *k* aumenta, o tempo de execução também aumenta. Os valores, por sua vez, aumentam ao se passar de *k* = 1 para *k* = 2, mas voltam a descer ao se passar de *k* = 2 para *k* = 4. Conclui-se, portanto, que utilizar *k* = 2 é a alternativa ideal, já que a penalidade no tempo de execução não é tão alta e o ganho no valor da solução final é desejável.

6.6 Teste do número de soluções iniciais geradas (parâmetro *nsi*)

Testou-se a geração de 1, 100, 1000 e 10000 soluções iniciais, das quais a melhor era passada ao Simulated Annealing. As figuras 6.6.1 e 6.6.2 mostram os resultados.

Figura 6.6.1 – Valor da solução encontrada em relação à variação de *nsi*

Figura 6.6.2 – Tempo de execução em relação à variação de *nsi*

A figura 6.6.3 mostra o valor médio da melhor solução inicial encontrada para cada valor de *nsi* testad.

Figura 6.6.3 – Valor da solução encontrada em relação à variação de *nsi*

Analisando os resultados, percebeu-se que o número de soluções iniciais geradas e, consequentemente, a qualidade da solução inicial, não é um parâmetro muito significativo para o Simulated Annealing: gerar apenas uma solução inicial, de valor próximo a 115000, levou a uma solução final melhor do que quando geradas 100 ou 1000 soluções iniciais, das quais a melhor tinha valor próximo a 122000. Além disso, notou-se que a qualidade das soluções iniciais fica bastante estagnada a partir de *nsi* = 100.

Ademais, o número de soluções iniciais geradas claramente não influi significantemente no tempo de execução do algoritmo, já que ao se criar 10000 soluções iniciais o algoritmo executou em menos tempo que quando se criou apenas uma solução inicial.

Conclui-se que qualquer número de soluções iniciais é aceitável; optou-se por utilizar, entretanto, 10000, uma vez que foi o que gerou melhores resultados em menor tempo.

7 TESTES DAS INSTÂNCIAS

O Simulated Annealing foi testado com dez instâncias do problema dos grupos balanceados de maior valor, disponíveis em <http://www.inf.ufrgs.br/~mrpritt/oc/gbmv>. Os valores utilizados para os parâmetros, escolhidos com base nos melhores valores encontrados nos testes da seção 6, foram: *r* = 0.99, *I* = 2500, *pf* = 0.01, *pi* = 0.95, *nsi* = 10000 e *k* = 2.

Cada instância de teste foi executada até o algoritmo se considerar resfriado e parar, de acordo com o critério de parada definido na seção 4.5. Os resultados são mostrados na Tabela 7.1 e na Tabela 7.2. As mesmas instâncias foram testadas utilizando-se o solver GLPK com limite de tempo de uma hora. Durante esse tempo o solver não conseguiu encontrar solução inteira factível para nenhuma das instâncias; logo, seus resultados foram omitidos das tabelas.

Tabela 7.1 – Desvio percentual da solução final em relação à inicial

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Instância | Solução Inicial | Solução Final | Desvio para Sol. Inicial (%) | Tempo de Execução (segundos) | Semente |
| gbmv240\_01 | 124660.52 | 214448.96 | -72.03 | 4000.98 | 0.5675159676256654 |
| gbmv240\_02 | 123240.66 | 195652.79 | -58.76 | 3576.21 | 0.059621963709868164 |
| gbmv240\_03 | 122075.76 | 188950.65 | -54.78 | 3671.96 | 0.3770736813695075 |
| gbmv240\_04 | 123883.04 | 216703.97 | -74.93 | 4413.43 | 0.04685611586595195 |
| gbmv240\_05 | 121311.73 | 186714.31 | -53.91 | 4462.87 | 0.39369572981800705 |
| gbmv480\_01 | 291035.83 | 487519.59 | -67.51 | 10589.82 | 0.16327551462745538 |
| gbmv480\_02 | 292048.27 | 444221.33 | -52.10 | 9201.84 | 0.7954544343146293 |
| gbmv480\_03 | 293184.37 | 451659.87 | -54.05 | 10879.43 | 0.3852361475080668 |
| gbmv480\_04 | 290508.99 | 469321.17 | -61.55 | 9041.52 | 0.265618411634559 |
| gbmv480\_05 | 287747.62 | 437918.84 | -52.19 | 8319.25 | 0.637818304285135 |

Tabela 7.2 – Desvio percentual da solução final em relação ao BKV

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Instância | Best Known Value (BKV) | Solução Final | Desvio para BKV (%) | Tempo de Execução (segundos) | Semente |
| gbmv240\_01 | 224964.8 | 214448.96 | 4.67 | 4000.98 | 0.5675159676256654 |
| gbmv240\_02 | 204624.4 | 195652.79 | 4.38 | 3576.21 | 0.059621963709868164 |
| gbmv240\_03 | 198937.2 | 188950.65 | 5.02 | 3671.96 | 0.3770736813695075 |
| gbmv240\_04 | 225683.2 | 216703.97 | 3.98 | 4413.43 | 0.04685611586595195 |
| gbmv240\_05 | 195521.0 | 186714.31 | 4.50 | 4462.87 | 0.39369572981800705 |
| gbmv480\_01 | 555993.1 | 487519.59 | 12.31 | 10589.82 | 0.16327551462745538 |
| gbmv480\_02 | 511107.9 | 444221.33 | 13.09 | 9201.84 | 0.7954544343146293 |
| gbmv480\_03 | 497652.2 | 451659.87 | 9.24 | 10879.43 | 0.3852361475080668 |
| gbmv480\_04 | 522604.8 | 469321.17 | 10.20 | 9041.52 | 0.265618411634559 |
| gbmv480\_05 | 484331.0 | 437918.84 | 9.58 | 8319.25 | 0.637818304285135 |

4 CONCLUSÃO

Lembrar de relacionar a melhora nos resultados ao aumentar k com o tamanho da vizinhança (stackoverflow). Relacionar a não-melhoria do resultado final ao obtermos uma solução inicial melhor com o fato de o simulated annealing não ser uma simples busca local, ele justamente tenta contornar o problema das buscas locais clássicas; essas tenderiam a se beneficiar de uma solução inicial melhor. xxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxx

referências

KIRKPATRICK, S.; GELATT, C. D.; VECCHI, M. P. **Optimization by Simulated Annealing**. [S.l.]: Science, 1983. 671-680 p. v. 220.

BURIOL, Luciana; RITT, Marcus; COSTA, Alysson M. **INF05010 – Otimização combinatória**: Notas de aula. Instituto de Informática, Universidade Federal do Rio Grande do Sul, Porto Alegre: [s.n.], 2018. 147-163 p.

BRADLEY, N. **The XML companion**. 3rd ed. Boston: Addison-Wesley, 2002.

OLIVEIRA, R. S. de; CARISSIMI, A. da S.; TOSCANI, S. S. **Sistemas operacionais**. 2. ed. Porto Alegre: Sagra Luzzatto, 2001. 247 p. (Série Livros Didáticos, 11).

SIMPÓSIO BRASILEIRO DE SISTEMAS MULTIMÍDIA E HIPERMÍDIA, 7., 2001, Florianópolis, SC. **Anais**... Porto Alegre: Sbc, 2001.

NATIONAL CONFERENCE ON ARTIFICIAL INTELLIGENCE, 17., 2000, Washington, DC. **Proceedings**... Menlo Park, CA: MIT Press, 2000.

**Parte de Monografia**

Capítulo (Autor do capítulo. Título do capítulo. In: Autor/Editor/Organizador do livro. **Título do livro**. Edição. Local de publicação: Editora, ano de publicação).

LUBASZEWSKI, M.; COTA, E. F.; KRUG, M. R. Teste e projeto visando o teste de circuitos e sistemas integrados. In: REIS, R. A. da L. (Ed.). **Concepção de circuitos integrados**. 2. ed. Porto Alegre: Bookman, 2002. p. 167-189.

ROESLER, V.; BRUNO, G. G.; LIMA, J. V. de. ALM: adaptative layering multicast. In: SIMPÓSIO BRASILEIRO DE SISTEMAS MULTIMÍDIA, 7., 2001, Florianópolis, SC. **Anais**... Porto Alegre: Sbc, 2001. p. 107-121.

PFEFFER, A.; KOLLER, D. Semantics and inference for recursive probability models. In: NATIONAL CONFERENCE ON ARTIFICIAL INTELLIGENCE, 17., 2000, Washington, DC. **Proceedings**...Menlo Park, CA: MIT Press, 2000. p. 12-19

**Dissertações, teses, trabalhos individuais, etc.**

AUTOR. **Título**. Ano. Folhas. Nota de tese ou dissertação (Grau e Área) - Unidade de

Ensino, Instituição, Local e data da defesa.

MENEGHETTI, E. A. **Uma proposta de uso da arquitetura trace como um sistema de detecção de intrusão**. 2002. 105 f. Dissertação (Mestrado em Ciência da Computação) – Instituto de Informática, Universidade Federal do Rio Grande do Sul, Porto Alegre, 2002.

**Artigo de periódico**

AUTOR do artigo. Título do artigo. **Título da revista**, local, volume, número, página inicial e final do artigo, mês e ano.

GONÇALVES, L. M. G.; CESAR JUNIOR, R. M. Robótica, sistemas sensorial e motos: principais tendências e direções. **Revista de Informática Teórica e Aplicada**, Porto Alegre, v. 9, n. 2, p. 7-36, out. 2002.

**Em meio eletrônico**

AUTOR do artigo. Título do artigo. **Título da revista**, local, volume, número, página inicial e final do artigo, mês e ano. Disponível em: <local do site>. Acesso em: dia mês ano.

LISBOA FILHO, J.; IOCHPE, C.; BORGES, K. Reutilização de esquemas de bancos de dados em aplicações de gestão urbana. **Informática Pública**, Belo Horizonte, v. 4, n. 1, p. 105-119, jun. 2002. Disponível em: <http://www.ip.pbh.gov.br/ip0401.html >. Acesso em: 20 set. 2002.

**Autoria Indeterminada**

Na impossibilidade de determinar a autoria, a entrada é pelo título da obra:

HIGH technology. Beverly Hills: Sage, 1985.

**Local e editora Indeterminados**

Não sendo possível determinar o local (cidade) de publicação, utiliza-se à expressão sine loco, abreviada, entre colchetes [S.l.]. Exemplo:

KRIEGER, G.; NOVAES, L. A.; FARIA, T. **Todos os sócios do presidente**. 3. ed. [S. l.]: Scritta, 1992.

Quando não for possível determinar a editora responsável pela publicação da obra, utiliza-se a expressão sine nomine, abreviada, entre colchetes [s.n.]. Exemplo:

GONÇALVES, F. B. **A história de Mirador**. São Paulo: [s.n.], 1993.

Quando o local e a editora não puderem ser identificados, utilizam-se [S.l.:s.n]. Exemplo:

PEDROSA, Israel. **Da cor a cor inexistente**. [S.l.:s.n], 1995.