# 考虑二次延误惩罚的单机调度问题启发式算法研究

# 绪论

## 选题背景及意义

从科技的角度来看，未来二、三十年人类社会将演变成一个智能社会，其深度和广度我们还想象不到[[1]](#footnote-1)。近些年来，得益于大数据技术的发展，人工智能逐步兴起，并开始影响人们的生活，智能家居、无人驾驶汽车、个性化推荐、人脸识别等等，都是人工智能给人类带来的科技福利。在大数据和人工智能时代的大背景下，信息科学、机器学习和运筹学分别扮演者不同的角色。数据的采集、挖掘、存储和管理属于信息科学的范畴；拿到数据后，根据数据做分析得出某些规律，这属于统计学习、机器学习甚至深度学习的范畴；而根据数据总结出的规律，决策人需要做决定的时候，既需要考虑方案的合理性，也需要考虑约束条件的限制，需要考虑成本代价或者最终受益，希望在复杂的规律中找到最优化的决策，这就是运筹学要解决的问题。可以预见的是，随着人们对更深层次更全局性优化决策的需求，运筹学必然会扮演着更重要的角色。

在有限数量可行解的集合中找出最优解的一类问题称为组合优化问题，它是运筹学的一个重要分支。所研究的问题涉及信息技术、经济管理、工业工程、交通运输、通讯网络等诸多领域。组合优化问题求解的是离散型变量的优化问题，其一般形式可以描述为：在满足一定的约束或者限制条件下，求取使得给定的目标函数值最大或者最小的解。

单机调度问题（single machine scheduling problem）是组合优化问题的一种，具有较高的理论研究价值，而且实际应用中有很多相关问题亟待解决，因此吸引了全世界研究人员的广泛关注。单机调度问题主要研究的是如何在一台给定的机器上安排一组加工任务，并希望该调度方案使得绩效度量达到最优。这类问题在实际生产生活中有广泛的应用，如适时生产理念（just-in-time，简称JIT）和供应链管理。适时生产理念提倡物品按需按量按时生产，无论是提前或者延后生产都不建议，都会对生产效益产生不好的影响，太早工厂库存压力大，太晚影响订单进度，因此理想的生产计划是所有的工作都在规定的时刻完成。单机调度问题在供应链管理中也有应用，将供应商比做生产机器，每道作业或者工序就是客户的配送任务，在实际中，强调供应商和客户之间的协调，要求尽量在指定的时间完成客户的配送，太早客户库存容量限制不能接受，太晚影响供应商信誉，也可能会使客户的其它安排滞后，所以安排合理的配送方案使得供应需求按时满足在供应链管理中就显得尤为重要。另外，在CPU调度、车间作业调度和机场飞机起降调度等问题中，单机调度问题都有广泛的应用。

根据约束条件或者求解目标的不同，单机调度问题有很多变种。一般来说，衡量单机调度问题效益的主要关注点在于作业加工的提前时间惩罚（Earliness）和延迟惩罚（Tardiness）。顾名思义，提前时间惩罚指的是由于作业实际完工时间早于作业要求的完工时间受到的惩罚，延迟惩罚指的是作业实际完工时间晚于作业要求的完工时间受到的惩罚。在不同目标的问题中，这两种惩罚的权重可能不同，文中主要研究的是线性的提前时间惩罚和二次的延迟惩罚问题。由于作业间不存在前后序关系，因此所有工序任意一种排列组合方式都是问题的解。因此如果需要求解最优方案，最差需要遍历所有可能的解，考虑件作业的单机调度问题，其搜索空间为个点的全排列的集合，其计算复杂度达到了*O*(*n*!)。

已经证明，单机调度问题属于典型的NP难问题。大多数组合优化问题都是NP难问题，如单机调度问题、旅行商问题、排课表问题、图着色问题以及蛋白质结构预测问题等等。在计算复杂性理论中，这类问题的计算复杂度很高，目前很难在多项式时间内求解。一般来说，求解组合优化问题有精确算法、近似算法和启发式算法。精确算法致力于找到问题的最优解，但由于问题的复杂性和计算机技术的制约，在有限的时间内很难利用精确算法求解，但这并不妨碍有毅力的研究人员致力于寻找精确的求解算法求解某些NP难问题。近似算法旨在通过数学推导，有限的时间内求取和最优解相差一定范围内的解，但在实际生活中往往和全局最优解相差很大，但并不能满足实际需求。启发式算法是比较常用的求解组合优化的方法，它来自于科学家们对大自然观察，受启发而创造，也因此而得名。通过总结大自然的运行规律或者面向具体问题的经验、规则来求解问题，通过循环迭代不断更新当前获得的解决方案，以便或者更好的解，并有机会得到全局最优解。

一般来说，启发式算法分为很多种，包括局部搜索、禁忌搜索、遗传算法和种群算法等等，其复杂程度和计算效率都不同，但对于不同的问题，不同的算法表现性能均不同，因此往往需要根据具体问题去设计算法，本文研究的目的也是为了找到求解带线性超前惩罚和二次延迟惩罚的单机调度问题的启发式优化算法。该问题在车间生产调度、供应链管理等领域中有广泛的应用，因此解决这一问题可以带来巨大的经济效益；而且单机问题属于NP难问题，求解这一问题具有重要的理论研究价值。

## 国内外研究历史及现状

单机调度问题是比较经典的组合优化问题，业已吸引了国内外众多学者的研究。生产调度问题的研究历史较为悠久，最早是由Johnson于20世纪50年代提出，距今60多年的历史。根据实际生产生活中的需要，后来诸多学者提出了几种不同求解目标的单机调度问题，并总结出了科学描述生产调度问题的方法。1967年Conway提出了调度问题的四参数表示法，后来Graham、Lawler等人（1979）提出了更好的三参数表示法（），其中用来描述机器的数量、类型等机器环境信息，用于描述工件的加工约束信息，用于描述目标函数。

单机调度问题是已被证明的NP难问题【引用】，由于其复杂性和多样性，很难找到一种通用的求解算法。一般地，解决单机调度问题的算法主要分为三类：第一种是精确算法，利用分支定界或者动态规划来求解；第二种是优先分配规则，属于构造算法；第三种是启发式算法，通过解的迭代更新，不断改进解。

* 精确算法

一般来说，求解单机调度问题的精确算法主要是分支定界（Branch and Bound）和动态规划（Dynamic Programming）两种。1990年Abdul-Razaq提出了两种动态规划方法和四中分支定界算法来求解考虑带权延误惩罚的单机调度问题。Potts和Van Wassenhove提出了求解延误惩罚权值相同的单机调度问题的动态规划算法，亦提出了延误惩罚权值不同时的分支定界算法。Ragatz、Luo和Bigras分别利用分支定界算法求解了带有准备时间的单机调度问题，Sourd提出了一种分支定界法来求解具有相同预期完成时间的单机调度问题，并同时考虑了超前时间惩罚和延误惩罚。Valente基于工序完成时间的松弛提出了一种求解单机调度问题下界的方法，并采用合适的下界，结合插入探测，提出了求解该问题的分支定界算法。最近，由Tanaka和Araki提出的一种精确算法找到了由Cicirello生成的考虑带加工准备时间和加权延误惩罚的单机调度问题的全部120算例的最优解；并用相同的算法求解延误惩罚不加权的单机调度问题【引用】，由62/64个算例得到了最优解。

动态规划或者分支定界等精确算法求解时一般可以获得较好的优度，但往往计算时间较长，对于较大规模的算例，需要几天甚至更久的时间，因此在实际中很难得到应用。

* TODO优先分配规则【待补充】
* 启发式算法

启发式算法主要包括局部搜索、禁忌搜索、遗传算法和混合算法等，在很多类型的单机调度问题上都有良好的计算效果。Potts和van Wassenhove提出了多种启发式算法来求解不带准备时间的单机调度问题，并发现通过成对交换工件加工位置是不错的策略。Holsenback提出了一种求解加权延误惩罚的单机调度问题，处理的问题规模可以达到50个工件数量。Feo 提出了一种贪婪自适应搜索算法（GRASP）来求解带准备成本和线性延误惩罚的单机调度问题。【需要扩充】Gonçalves提出了基于随机关键字的几种遗传算法，这些遗传算法大致相同，只是在生成初始解和利用局部搜索收敛时有差异。Valente and Schaller针对考虑机器准备时间和不考虑准备时间的单机调度问题，均提出了几种解决问题的启发式算法。Rubin和Ragatz提出了一种遗传算法（GA）用来求解最小化总延迟的单机调度问题。Tan和Narasimhan提出一种模拟退火算法（SA）来解决带准备时间的单机调度问题，Armentano和Mazzini[69]同样则提出用遗传算法（GA）解决该问题，而Franca等人则提出了一种混合进化算法（Memetic）算法解决考虑准备时间的单机调度问题。

对于既考虑准备时间也考虑延误惩罚权重的单机调度问题，也有众多的学者参与研究。Cicirello 和Smith为生成了120个带准备时间带延误惩罚权重的单机调度问题算例，每个算例包括60个工件；并且他们还分析了一些随机抽样方法与模拟退火算法搭配在一起的性能。Lin和Ying对比了遗传算法（GA）、禁忌搜索算法（TS）以及模拟退火算法（SA）在求解该类单机调度问题时的表现。Valente提出了几种基于束搜索的启发式算法，这些启发式算法既包括利用优先级和总惩罚值来进行评估的束搜索算法，也有带可变束和过滤宽度的变体。近年来Tasgetiren等人[82]提出的离散差分进化算法（Discrete Differential Evolution， DDE）以及Kirlik和Oguz[83]提出的变邻域搜索算法（GVNS）大幅度的改进了该类单机调度问题算例的解。2014年，Xu提出了基于“块移动”迭代局部搜索算法和混合进化算法来求解，在很多算例上得到了当前最好解。

## 本文主要工作及结构安排

本文主要研究的是单机调度问题的一种——考虑

# 单机调度问题及启发式算法概述

## 单机调度问题

单机调度是生产生活中比较常见的组合优化问题，下面的内容给出该问题的描述以及按照约束条件和求解目标的分类。

### 问题概述

生产调度问题主要是研究如何在一台或者多台机器上加工生产线上的工件。一般来说，在各个工件都有预期的完工时间，甚至工件之间还有可能会有先后序关系，生产调度就是在满足各个约束限制条件下，制定出生产计划，规定每个工件的加工顺序或者时间，以期望实际生产尽可能在安排的时间完成。

单机调度问题，顾名思义，指的是所有的工件都在 一台机器上进行加工，这在某些贵重仪器加工上比较常见。另外，单核CPU上作业的调度，机场跑道上飞机起飞或者降落的调度也可以抽象成单机调度问题。求解单机调度问题，就是希望在有限的资源下，通过制定合理的工件加工计划，平衡所有工件的完工时间，最小化违约惩罚，最大化经济效益。

### 单机调度问题分类

单机调度问题根据约束条件和求解目标的不同有多种不同类型，不同类型的单机调度问题需要设计不同的求解算法，很难找到普遍性的解决单机调度问题的算法。

* 根据机器类型划分
  + 抢占式：工件在加工的时候允许被抢占，加工到一部分的时候，可以让机器转去完成其它工件的加工，等另外的工件完成后反过来完成剩下的部分，这在CPU调度中较为常见；
  + 非抢占式：即加工时不允许抢占，只有当当前工件完成了加工，机器才能开始下一个工件的加工；
* 根据是否考虑准备时间来划分：
  + 考虑准备时间：当某个工件加工完成后，紧接着加工的工件需要等待一段时间后才允许在机器上开始加工；
  + 不考虑准备时间：加工完成一个工件后可以马上进行下一个工件的加工；
* 根据机器是否允许有空闲时间：
  + 允许空闲时间：为了避免超前惩罚，允许机器空闲一段时间之后再开始加工；
  + 不允许空闲时间：机器不允许空闲，工件加工时间时紧密相邻的；
* 根据目标函数划分：
  + 不带权延误惩罚：当每个工件的实际完工时间比工期晚时，有延误惩罚，调度需满足所有工件的延误惩罚之和最小；
  + 考虑带权延误惩罚：每个工件的延误惩罚的权值不相同，调度需考虑使得所有工件的带权惩罚值之和最小；
  + 考虑超前惩罚和延误惩罚：不仅考虑工件的延误惩罚，当工件的加工时间比工期早，也有超前惩罚值，调度需满足超前惩罚和延误惩罚的和最小；
  + 考虑超前惩罚和二次延误惩罚：该种单机调度问题既考虑了超前惩罚也考虑了延误惩罚，而且实际生活中，一般延误惩罚比超前惩罚更严重，因此延误惩罚是二次的，这也是本文所研究的问题。

## SMSP-LEQT问题模型

根据约束条件和目标函数的不同，单机调度问题可划分成多种类型，本论文主要研究的是带线性超前惩罚和二次延误惩罚的单机调度问题（single-machine scheduling problem with linear earliness and quadratic tardiness penalties，以下简称SMSP-LEQT问题），下面使用自然语言和形式化语言相结合的方式给出该问题的数学模型。

给定包含个工件的集合，每个待加工的工件都有加工所需的时间（用表示）以及期望的加工完成时间（用表示）。所谓单机调度，即只给定一台加工机器M，这在价格昂贵的精密仪器加工机床、单核CPU或机场等场景比较常见。这个工件需要分别在机器M上加工完成，加工的时候不允许抢占，即对于任意两个不同的工件，当工件在加工的时候，必须等待加工完成后才能在机器M上加工。这些工件是相互独立的，即任意两个工件之间不存在前后序关系，二者间的加工前后关系是可选的，不存在任何限制。机器M在0时刻就可以认为准备就绪，工序加工没有空闲时间，即当某一个工件加工完之后，可以认为在上一个工件的加工结束时刻就允许开始下一个工件的加工。从上述描述的分析来看，单机调度问题的一个合法解可以用这个工件的加工序列来表示，所以单机调度问题一般也被称为排序问题。用表示工件是否在第个加工，表示是在机器M上加工的第个工件，反之则不是。根据问题描述，存在如下约束：

公式(2.1)中，第一个约束表示每个工件都会被加工，而且只被加工一次；第二个约束表示每个工件不允许抢占，每个时刻只允许一个工件在机器上被加工。

每个工件加工需要一定的时间，而且只有一台机器M可以使用，加工能力有限，因此不一定每个工件都能在指定安排的时刻完成加工。由于SMSP-LEQT问题中**不考虑工件的准备时间**，而且机器M**不允许抢占**，也**不允许有空闲时间**，因此一个合法的调度计划可以直接用一个工件序列来表示，如图 2.1所示，因此单机调度问题一般也被称为序列问题。

[需要画图]

图 2.1 单机调度问题合法解示意图

用表示工件的实际完工时间，存在如下惩罚值定义：

* 超前惩罚(earliness)：如果工件的实际加工时间早于工件的期望完工时间，则会有超前惩罚（如难以保存或者积货影响库存），用0截取表示当加工完成时间晚于期望时间时不会有超前惩罚；
* 延误惩罚(tardiness)：如果工件的实际加工时间晚于工件的期望加工时间，则会有延误惩罚(如影响交货时间或者飞机延误等等造成的损失),用0截取表示当加工完成时间早于期望时间时不会有延误惩罚；

在一般单机调度问题中，超前惩罚和延误惩罚都是一次项，即对于这两种惩罚来说，认为的不良后果是相同的，在带权延误惩罚值的单机调度问题中考虑的仅仅是不同的工件带来的延误惩罚会不同。而在SMSP-LEQT问题中，超前惩罚是一次的，延误惩罚是二次的，即认为延误交货时间带来的后果往往更严重，这在如机场调度等场景中十分常见，飞机延误不仅会影响其它飞机调度，还严重影响乘客的满意度。根据上面的描述，SMSP-LEQT问题的求解目标定义如下：

## 启发式算法概述

在实际生产生活中，往往会遇到一些大规模的复杂优化问题，如机场航班调度、停机位分配问题、护士排班问题、负载均衡、车间作业调度和车辆路由问题等等，这些问题都是NP难问题，目前求解NP难问题的主要算法有精确算法、近似算法和启发式算法三种，应用最有效最广泛的当属启发式算法。启发式算法（Heuristic）指的是人们受大自然的启发，通过总结经验和规则来求解问题的算法。实际中的组合优化问题往往求解难度很大，而且在大多数场景下，要求能快速决策，给出解决方案。一般地，精确算法很难在比较短的时间内找到较好的解，而启发式算法通过对问题的分析以及结合实际中的方案规则，能在合理的时间内得到较好的解，但启发式算法的求解性能缺乏理论支持，往往是通过实际求解结果来验证其性能。

启发式算法一般分为个体优化算法和种群优化算法。个体优化算法包括局部搜索、禁忌搜索、模拟退火等等，种群优化算法包括遗传算法、蚁群算法、粒子群算法等等。对启发式算法来说，好的算法设计既要考虑到解的集中性，也要考虑到解的疏散性。所谓集中性，指的是解能够快速迭代更新优化，更快找到或者收敛到局部最优解；所谓疏散性，指的是搜索更广阔的解空间，更有利于增加搜索到全局最优解或者更好解结构的可能性。个体优化算法更着重于体现解的集中性，但并非完全不考虑解的疏散性，一般会通过扰动或者禁忌表来增强解的疏散性。种群优化算法也并非完全指考虑解的疏散性，它通过解的交叉来扩展解空间，但依然会通过一些简单快速的局部搜索算法来使种群中的个体收敛到更优的解。本文求解单机调度问题主要运用了局部搜索和禁忌搜索两种算法，这里简单地介绍下局部搜索和禁忌搜索的概念。

### 局部搜索概念

局部搜索，顾名思义，就是通过有效的搜索策略，找到局部最优解。局部搜索的主要过程是从一个初始解出发，通过在解空间中搜索当前解的邻域，找到邻域中更好或者最好解，并用找到的新解替换当前解，重复上述过程直到解不再更新为止。

局部搜索算法设计主要集中在三个方面：邻域结构设计，评估函数设计以及达到局部最优后如何进一步拓展解空间。所谓邻域结构，指的是如何从当前解出发得到邻域解空间。一般来说，邻域解是通过在当前解的基础上，对解的构成做比较小的改动（称为邻域动作），得到新的解。当然，做邻域动作需要保证解的合法性不受影响。邻域空间越小，从邻域中找到最优解的速度越快，但搜索的范围小，不一定能覆盖到好的解，很容易陷入局部最优；邻域空间越大，从邻域中找到最优解的速度越慢，但搜索的解数量多，更容易持续更新当前解。因此，好的邻域结构设计也要考虑集中性和疏散性的平衡，既需要保证搜索的效率，也要尽可能搜索到更多的优质解，避免很快陷入局部最优。评估函数指的在确定邻域结构之后，如何从邻域中选择新的解替换当前解，这依赖于评估函数的选择。评估函数需要从领域解结构中挑选出优质的解，一般来说评估函数直接反应了目标函数的值或者目标函数的变化量，旨在不断得到更优的解。评估函数的确立也要注意搜索的效率，由于局部搜索中往往需要大量重复使用评估函数来评估，高效的评估函数可以极大的提高搜索效率。

局部搜索一个重要的特征就是算法在执行过程中会逐步陷入局部最优，即当前解就是邻域中的最优解时，算法将无法搜索更好的解，因此需要设计某种机制，如对解进行扰动（较大程度改变解的结构）扩展新的搜索空间。扰动机制的作用是希望跳出局部最优，因此扰动的幅度不能太小，避免又回到局部最优解；扰动的幅度也不宜过大，幅度过大的扰动类似于重新生成初始解，之前搜索得到的解毫无作用，不易于保持优良的解结构，会因为无效率的搜索大幅度降低算法的计算速度和性能，也不利于进一步改进解。

### 禁忌搜索概念

禁忌搜索（Tabu Search或Taboo Search，简称TS）的思想最早由Glover(1986)提出[引用文章]，它是对局部领域搜索的一种扩展，。禁忌搜索的主要思想是通过特殊的存储结构记录搜索过的解空间。当然，一般来说很难直接将搜索过的解完全保存下来，通常是通过记录一些邻域动作，来判断当前的邻域动作是否被禁忌。

禁忌搜索的大致流程和局部搜索很相似，也是从一个初始解出发，通过搜寻邻域中的解来不断更新当前解。但与之不同的是，禁忌搜索通过禁忌表来记录搜索区域避免迂回搜索。在禁忌搜索的过程中，会将搜索过的解或者动作记录在禁忌表中，禁忌表中的元素也并非一直被禁忌，每个元素的禁忌时间称为禁忌长度，当迭代一段时间之后允许禁忌表中的元素被解禁，避免漏掉结构性良好的解。由于禁忌表的存在，禁忌搜索在每次扩展邻域的时候会将邻域解集合划分为受禁忌的候选集和不受禁忌的候选集，确立邻域最优解会从不受禁忌的候选集中的元素中挑选，但也存在一些例外情况，称为特赦准则。所谓特赦准则，指的是有一些邻域解虽然被禁忌，但为了获得更好的解，也必须选择，所以一般认为如果当前解的目标函数值优于找到的最好解的目标函数值，即便该解被禁忌，也允许选择该动作来替换当前解。

从禁忌搜索的流程上来看，禁忌表的设计显得尤为重要。一方面，禁忌表要对搜索过的解空间进行封闭，因此禁忌表既不能漏掉太多搜索过的空间，不然难以避免迂回搜索；另一方面亦不能将未搜索过的解标记为禁忌状态，否则可能会因为错误的标记漏掉结构较好的解。禁忌表不但需要保存禁忌元素，还要判断邻域解是否处于禁忌状态，因此保证禁忌判断的效率也显得尤为关键。由于组合优化问题的结构一般比较复杂，即便是本文研究的单机调度问题，其解也是工件的序列，但如果禁忌表中直接保存单机调度问题的解，那可能搜索的绝大部分时间开销都是在判断当前工件序列是否和解中的一致，显然算法的性能大打折扣，因此通常来说会将一些邻域动作加入到禁忌表，既能通过判断邻域动作是否在禁忌表中来快速判断当前解是否被禁忌，也能有效地避免迂回搜素。

# 求解SMSP-LEQT的多邻域迭代局部搜索算法

求解组合优化问题的启发式算法有很多，包括局部搜索、禁忌搜索、遗传算法、蚁群算法等等。对于SMSP-LEQT问题，本文设计了一种带多种扰动机制的迭代局部搜索算法来求解。局部搜索是比较简单而且较容易实现的算法，但对于组合优化问题，并不是计算的算法越复杂，效果越好，简单的算法，如果能对问题理解地更透彻，往往也有较好的效果，用简单的算法来求解复杂问题，也是算法优势的体现。当然，由于局部搜索的局限性，当单机调度问题的规模较大的时候，很容易陷入局部最优，因此本文设计了一种多扰动机制来增强解的疏散性。下面首先介绍迭代局部搜索算法的具体流程，然后再结合实际研究的SMSP-LEQT问题来详细描述针对该问题的求解算法。

## 迭代局部搜索算法

迭代局部搜索算法是一种常见的解决组合优化问题的算法，也是比较容易实现的算法，它在解决护士排版问题【待补充】等都有很好的应用。本节主要介绍迭代局部搜索算法的详细过程和在求解SMSP-LEQT问题时的具体应用。

### 基本思想

局部搜索的过程在2.3.1中已经阐述，主要是通过邻域动作从当前解出发获得多个邻域解，从中挑选出一个解替换当前解，达到更新解的目的。但如果当前解就是邻域中的最好解时，局部搜索就会陷入局部最优，无法再进行搜索，所以常迭代使用局部搜索算法。因此，很多时候会通过重启局部搜索来扩大搜索范围。但随着问题规模的增大，重启的效果变得越来越差，因为重启是通过重新构造初始解再应用局部搜索。但由于随机构造的初始解和全局最优解往往相去甚远，完全从初始解出发，很快就会收敛，很难具备达到全局最优解的条件。一般迭代局部搜索不通过重启来进行迭代，而是在局部最优解的基础上进行扰动，也就是对局部最优解进行微小的调整，再从扰动后的解出发，重新进行局部搜索。因为扰动是从局部最优解为基础，所以在一定程度上保留了之前搜索到的优良的解结构，而且通过扰动，可以在不同的邻域解空间进行局部搜索，搜索的疏散性显著增强，有助于找到优度更高的解。

### 迭代局部搜索流程

|  |
| --- |
| **Algorithm 1** General framework of local search |
| **1:** |
| **2: Repeat:** |
| **3: Repeat** |
| **4:** choose best or better solution from N(s) |
| **5:** |
| **6: Until**  is not better than |
| **7:** |
| **8: Until** stop condition is meet |

迭代局部搜索算法的主体框架如所示。迭代局部搜索算法会首先构造一个合法的初始解（第一行），如何生成初始解要根据具体的问题来决定。初始解的构造约精细，越能很快收敛到局部最优解，而且初始解的结构越好，越容易收敛到更好的解，但一般来说，初始解的构造不需要太复杂，好的局部搜索算法不能太依靠初始解的构造，无论初始解的构造结果如何，通过迭代进行局部搜索均能得到较好的求解方案。通过邻域动作，从当前解出发得到其邻域解集合，根据设计的评估函数和接受准则，从中选择一个邻域解替换当前解（第四行）。如果得到的新解比当前解要优，则用新的解替换当前解（第5行）；如果当前解释邻域中的最优解，则表示陷入了局部最优，局部搜索停止（第6行）。以上过程就是局部搜索的主要过程，陷入局部最优之后就需要通过扰动来进行新一轮的迭代搜索（第7行），通过扰动从局部最优解到达新的搜索起点，继续进行局部搜索，迭代局部搜索就是不断完成扰动和局部搜索的过程。

迭代局部搜索中局部搜索是迭代反复执行的，需要设定程序的停机条件。一般来说，迭代局部搜索的停机条件可以使静态的也可以是自适应的。静态的指设定固定的求解时间，但这种方式很少使用，因为对于不同规模的算例来说，设置相同的计算时间显然是不太合理的，所以多采用自适应的形式。所谓自适应，指的是根据当前解的更新情况来决定是否继续搜索。当进行几次迭代局部搜索的时候，解一般会呈现比较明显的优化趋势，显然在这个时间点是应该继续搜索的。当迭代一段时间之后，可能解的优化速度放缓，甚至很长的一段时间解都没有更新，这时候就要考虑是否停止搜索了。一般地，会设置某一个迭代代数阈值，当迭代次数超过这个阈值，搜索到的解一直没有更新，算法就会自动停止。

### 评估函数和接受准则

设计邻域动作得到邻域动作之后，算法需要从邻域解集合中选取合适的解替换掉当前解，这依赖于评估函数的选择。一般来说，评估邻域动作或者评估邻域解主要有三种方式：

* **评估完整目标函数**

评估完整目标函数是通过直接计算并比较解的目标函数值来决定的。这种方法一般比较容易实现，但实现时一般要遍历所有的决策变量，如单机调度问题中需要计算所有工件的超前惩罚和延误惩罚，这显然是非常消耗计算资源，效率极低的做法，问题规模越大，该方法的弊端越明显，所以一般情况下不采纳。但某些问题可能约束条件太多，或者邻域动作导致的变化太大，才会采用直接计算的方式。

* **增量评估**

增量评估是一种比较常用的评估方法，指的是不直接计算解的目标函数值，而且通过计算邻域动作引起的目标函数值变化量来达到评估邻域解的目的。一般邻域动作都是对解做比较微小的改动，所以增量评估只需要计算特别少的部分，计算量很小，在同样的时间内可以进行多次迭代，解更容易更新，大大提高了算法求解性能和效率，因此增量评估被应用的场景比较广泛，在设计评估函数的时候也一般会优先考虑能否使用增量评估的方式。

* **近似评估**

在某些问题场景下，尤其是复杂的实际或者工业问题中，涉及的约束较多，因为邻域动作带来的解结构的变化量很大，很难通过增量评估来达到快速评估的目的，但计算完整的目标函数值同样会消耗很大的时间代价，因此可以考虑采用近似评估的方法。即不直接计算目标函数值，而是通过一些策略对目标函数做一些改进，比如有些问题中会通过评估下界（或者上界）来达到评估的目的，通过近似函数替代目标函数，也能继续采用增量评估的策略，进一步提高搜索速度。这种方法在近似函数选择适当的时候会很有效果，既能大大提高搜索速度，也能达到优化解的目的，但往往近似函数的选择比较难以权衡和证明。

通过评估函数可以评估邻域中解的优度，但如何从邻域中选择合适的解来替换当前解也是需要考虑的。一般来说，邻域解的接受准则有两种：

* **最优改进原则（Best ImprovedPrinciple）**

最优解原则就是要求评估邻域中的所有解，并根据评估函数选出评估值最优的解。这种接收准则必须检验邻域内所有解的评估函数值，可以选出最好的解来替代当前解；但当邻域空间增大的时候，评估的代价会很大，每次都需要遍历所有的邻域解。

* **第一次改进原则（First I****mproved Principle）**

第一次改进原则指的是选择第一个目标函数值或者评估函数值优于当前解的邻域解，即搜索到更优的邻域解就替换当前解。这种方式一般在搜素的前期会迭代的很快，因为当解的优度不是很高的时候，邻域解中的更优解较多，迭代速度较快；但因为不是选择的最优解，有可能会漏掉邻域中更好的解。

这两种邻域解的接收准则各有其优缺点，一般来说，当邻域评估比较快速的时候，按照最优解原则可以快速找到邻域中最好的解，当邻域评估比较困难，一次邻域动作的评估比较复杂时，可以选择第一次改进原则，达到快速迭代的目的。

### 扰动机制

局部搜索一个很大的弊端就是容易陷入局部最优，即当邻域中的最好解就是当前解本身的时候，局部搜索就停止了，因此需要重新设置局部搜索的起点。一般地，采取多次重启的机制，可以很方便地迭代进行局部搜索，但往往这种方式效率很低，之前搜索的局部最优解没有保存其优良的解结构，几次局部搜索很少能得到更优的解。扰动是一种比较简单易实现的增强解的疏散性的方式，扰动指的是在局部搜索陷入局部最优之后，在局部最优解的基础上对解进行一定的改动。扰动既要保持解的优良结构，也要和当前解有较大区分，这样搜索空间才会扩展。扰动的设计理念来自于“物以类聚”的思想，一般认为目标函数值较优的解应该具有相似的结构，扰动就是利用这种相似结构对解进行拓展，为了在迭代局部搜索过程中搜索到更广泛的解空间。相较于邻域动作，扰动的动作幅度要稍大一些，否则扰动之后只是重复之前的搜索过程，无任何意义；扰动的幅度也不能过大，否则局部最优解丧失了其优良结构，扰动之后的搜索过程和重新构造初始解无异，也就失去了扰动的意义。

在不同的问题中，扰动的方式均不同，这依赖于不同问题的解结构。但一个很简单的思想是，根据求解算法中的邻域动作，进行较多次操作，可以认为是一个比较好的方案。在排列问题中，元素的顺序就是问题的解，可以采取打乱某一部分的顺序来进行扰动，这部分的数量的多少也就决定了扰动的幅度；在图着色问题中，顶点着的颜色是问题的解，对于一个局部最优解，随机改变一定数量顶点的颜色，可以作为一种扰动手段；在顶点覆盖问题中，选择的顶点集是问题的解，可以从中删除一部分结点，并按照约束添加必要的新结点，就可以达到扰动的效果。在这些问题中，这些扰动动作很类似与邻域动作，但一般涉及到多个元素，比邻域动作的幅度大很多。而且因为不是完全的重新构造，排列问题中很大一部分元素的顺序、图着色问题中大部分顶点的颜色和顶点覆盖问题中大部分的顶点集都是和扰动前的局部最优解一致的，因此解的部分结构被保存下来，部分结构发生了变化，既考虑了算法的集中性，也考虑了疏散性。

TODO排序改排列

## 求解SMSP-LEQT的启发式算法设计

本论文研究的是带线性超前惩罚和二次延误惩罚的单机调度问题（SMSP-LEQT），并采用迭代局部搜索的方法来求解。迭代局部搜索算法是一种比较简单易实现的启发式算法，在很多组合优化问题上表现了极好的求解性能。为了增强迭代局部搜索算法在SMSP-LEQT的表现，文中设计了多种邻域动作，增大搜索空间，并设计了复杂的扰动机制，达到了很好的疏散性，下面就详细描述求解SMSP-LEQT的启发式优化算法。

### 总体求解框架

依据迭代局部搜索的主体框架，本文设计的带多动扰动机制的迭代局部搜索算法（iterated local search based on multi-type LS-MP），通过局部搜索找到局部最优解，通过多扰动机制去探寻新的可能的搜索空间，二者交替使用来求解SMSP-LEQT问题。具体地，算法首先会构造初始解（见3.2.2节），并应用梯度下降算法搜索局部最优解（见3.2.3节），在梯度下降算法的每一次迭代过程内，均会随机选择一种邻域结构来搜索局部最优解，可选的邻域动作包括工件插入和交换这两种邻域结构，并按照最优改进原则选取邻域中的最优解作为接收准则。如果当前解的邻域中不存在比当前解更好的解，则表示梯度下降算法（亦称为局部搜索算法）陷入局部最优。当出现这种情况时，ILS-MP算法会启动多扰动机制，扰动机制中包括基于禁忌的扰动动作、基于构造的禁忌动作和随机的扰动动作三种，进行扰动的时候，算法会从这三种扰动动作中选择一种。这三种扰动动作选择的概率是不一样的，会优先选择基于禁忌的扰动动作，然后选择基于构造的扰动动作，在极小的概率下选择完全随机的扰动动作。在执行扰动的时候，不仅会给出当前搜索到的局部最优解，也会根据给出的扰动动作次数L来控制扰动的幅度。扰动之后的解即为新的局部搜索算法的起点，并迭代进行下一轮的下降搜索，多次迭代之后找到的最优解会被保存下来，即就是迭代局部搜索找到最终结果。迭代局部搜索会不断进行迭代，以希望搜索更大的搜索空间，但当很长一段迭代时间内（超出迭代步长）搜索的结果没有改进，就表示算法无法继续持续改进，算法达到终止条件。

|  |
| --- |
| **Algorithm 1** ILS for SMSP-LEQT |
| **1:** Generate an initial solution |
| **2:** |
| **3:** |
| **4: while do** |
| **5:** |
| **6: if**  is better than **then** |
| **7:** |
| **8:** |
| **9: else** |
| **10:** |
| **11: end if** |
| **12: if**  **then** /\* is a coeff.\*/ |
| **13:** |
| **14: else if**  /\* is a coeff.\*/ |
| **15:** |
| **16: else** |
| **17:** |
| **18: end if** |
| **19: end while** |
| **20: return** |

算法的总体框架如**Algorithm 1**所示，下文将详细介绍ILS-MP求解算法的各个部分内容。

### 构造初始解

一般来说，对于迭代局部搜索算法，初始解的构造不需要太复杂，应该尽可能依靠局部搜索的性能去对解进行改进，这也是评价局部搜索算法优劣的一个方面。初始解的构造也不能过于随机，因为对于大规模的组合优化问题，局部搜索的解空间有限，完全随机的初始解所在的解空间可能和全局最优解相距甚远，最终得到的解的质量可能不高。

对于给定的包含个相互独立工件集合，本文用一种贪心的启发式方法来构造初始解，也就是得到一个包含这个工件的有序集。具体地，首先会被置为空集，并从工件集合中随机选择一道工件加入到中，此时，随机选择的工序会根据评估函数（见3.2.4节）来决定最佳的插入位置，因为是有序工件集，工件的顺序决定了问题的解。中添加了新的工件元素，即。因此，构造初始解时，会在集合和中不断进行工件的添加和删除，直到集合中的所有工件被完全加入到中，初始解的构造算法停止，得到了局部搜索的起始解。

在设计迭代局部搜索算法的初始解时，曾经设计过采用比较复杂的NEH启发式算法【引用】来构造初始解，但得到的结果和应用上文描述得到的简单的构造算法的得到的最优解并没有相差你，这也表明本文设计的带多扰动机制的局部搜索算法性能较强，当陷入局部最优之后，会利用多种不同类型的扰动策略来扩展搜索区域，并取得了比较显著的成效，也也印证了本文ILS-MP算法的优势。

### 邻域动作和局部搜索

迭代局部搜索算法中比较核心的部分就是邻域结构，邻域结构的大小既决定了搜索的广度，也决定了搜索的深度。进行局部搜索的时候，需要从邻域中找到更优的解，因此邻域空间不能太小，否则难以覆盖到改进解，局部搜索很快陷入局部最优；邻域空间也不能过大，否则邻域进行邻域评估的时候，效率会很低，每次搜索邻域最优解的时间很长，影响搜索的效率。根据SMSP-LEQT的问题特点和该问题合法解的构成，本文设计了两种不同的邻域动作来构造邻域空间进行搜索，即插入动作和交换动作，局部搜索过程中每次迭代都会从二者间选择一种方式作为邻域动作。

具体地，**插入动作**指的是将工件序列中的某道工件插入到其它工件之前或之后。对于给定的道工件序列，将插入到工序插入到工序之前或之后，即对于每一道工件，均有个可能的插入位置（除去本身的位置），故其邻域空间内大约有个可能的邻域解，当然，其中可能包含少量重复的位置。图XXX给出了插入动作的两个示例，分别演示了插入到工件之前和之后两种动作。图XX表示将工序插入到工件之前，图XXX表示将工序插入到之后。**交换动作**指的是将工件序列中某两个工件交换顺序，图XXX给出了和工件交换的邻域动作，任意两个工件之间的交换均是允许的，因此一共有种可能的交换动作。

显然，对于个工件规模的SMSP-LEQT问题，插入邻域动作和交换邻域动作的邻域空间大小均为，所以邻域评估的代价较大。为了解决邻域搜索的效率问题，本文针对插入动作和交换动作的距离做了限制处理。对于插入动作，其插入距离，即对于工件的插入动作的插入距离用工件的原位置和新位置差的绝对值来表示，也就是插入位置和原位置之间的工件数量。对于交换动作，其交换距离，即对于工件和工件的交换动作，其交换距离就是两个交换工件位置差的绝对值，也就是工件和工件之间间隔的工件数量。为了减少评估的时间，我们对这两种动作的距离都做了限制，任意一个工件的插入动作的距离不允许超过，任意两个工件间的交换动作的距离不允许超过，距离超过限制阈值的邻域动作均是不参与邻域评估的。考虑移动的距离，是为了减少邻域评估的时间，尽可能短的时间内找到邻域中的最优解，而移动的距离太远，邻域动作导致的解的变化太大，不适合作为邻域解考虑。而事实也是，一般算法执行中得到的比较优质的解，工件的加工结束时间不会和其工期相差过远，以插入动作为例，如果移动的距离过长，距离工期极远，该工件的惩罚值会特别大，严重影响解的质量。当解本身特别差，工件的结束时间普遍和工期相差较远，那么长距离的移动也可以通过几次短距离插入来玩成，同样可以通过邻域动作得到更好的解。通过限制邻域动作移动距离的方式，完全可以在不影响解的质量的情况下大幅度节省计算时间。

【插入图片】

利用工件的插入和交换动作实现的邻域结构， ILS-MP算法通过简单最优化接受原则实现了简单的局部搜索。在每次局部搜索迭代的时候，会按照一定的概率从插入动作和交换动作中来随机选择某一种邻域结构，并在众多邻域解中选择目标函数值最优的邻域解来替换当前解。局部搜索会不断迭代进行上述过程，直到获得局部最优解不再更新为止，这也代表当前邻域中并不存在比当前解更好的解，局部搜索无法继续执行。

### 邻域快速评估策略

3.2.3节中提到了两种邻域动作——工件的插入和交换，无论是哪种邻域动作，其可能的邻域大小均是，因此必须使用快速评估策略，否则邻域评估的代价太大，邻域搜索时间过长，迭代的次数有限，很难在较短的时间内得到好的解。在3.2.3节已经通过设置插入动作和交换的动作的距离阈值来限制邻域结构的大小，在本节中设计了一种针对插入动作和交换动作的邻域快速评估策略，进一步提高邻域搜索的效率。

一般的评估策略主要有三种：全量评估、增量评估和近似评估。全量评估指的是直接计算解的目标函数值，在SMSP-LEQT问题中需要对每个邻域解计算道工件的提前惩罚和延误惩罚，这样计算的代价显然是巨大的，不适合应用在本问题中。而近似评估由于评估值是通过计算目标函数值近似值的方式，SMSP-LEQT问题的解结构比较简单，不需要采用近似评估的方式。针对插入动作和邻域动作导致的解结构变化，设计了增量评估的方式来进行快速搜索。

如图XXX所示的例子，在当前解的基础上，对比将工件插入到工件和之前的两种邻域动作，其中和在当前解的序列中是相邻的，并且在之后，在之后，在向前插入的邻域结构中，这两种邻域动作在评估的时候是紧接着被评估的。对比这两个邻域动作形成的新解，红色框中的工件其完成时间是一致的。对于之前的工件，邻域动作不会影响其加工，完成时间不变，因此这两个解中及其之前的工件的惩罚值是相同的；对于之后的工件，因为和之间所有的工件完成之后的总时间没有变化，所以做完邻域动作后，之后的工件的完成时间不变，两个解中这部分的惩罚值也是相同的；而对于和之间的工件（包括），虽然邻域动作会导致这部分工件的惩罚值有变化，但比较这两个新解，因为均是在和完成之后开始的，因此这两个新解中和之间的工件的完工时间是一样的，惩罚值也相同。如果要计算插入到之前形成的解的目标函数值(用表示)，只需要通过插入到之前形成的解的目标函数值（用表示）并结合二解的差值得到，而从前面的分析可知，要计算差值，仅仅需要计算和这两个工件的目标函数值变化，即，其中和分别表示图XXX对应的解中工件和的惩罚值，和表示图XXX对应解中两个工件的惩罚值。计算该值是非常省时的，评估一个邻域解的时间复杂度仅为，且这种增量评估的方式非常适合迭代，因此可以很高效地计算工件插入到所有可能位置的目标函数值。同样地，往后插入的邻域动作也可以采用这种方式增强评估，这里不再详细举例了。

图XXX给出了交换动作的快速评估策略，同样采取增量评估的策略，但相较于插入动作，需要重新计算的部分更多。图XXX中是将工件和交换位置，图XXX中是将工件和交换位置，和在原解中是相邻的。对于原解中之前的工件，交换两工件的顺序完全不会影响，所以这部分工件的惩罚值不会发生变化，不需要重新计算；对于之后的工件，由于前面所有工件的完成时间不会发生变化，因此这部分工件的惩罚值也不会变化，也不需要重新计算；但和之间的工件（包括二者）在新的两个解中的工件的完工时间明显不同，都需要重新计算。但这里并不需要计算着两个新解中这部分工件的惩罚值，可以直接通过计算新解和原解的目标函数值变化，如图XXX所示更清晰明了，有，其中表示执行交换动作之后新解的目标函数值，和分别表示交换动作前后和之间各个工件的惩罚值。可以看出，相较于插入动作，交换动作需要重新计算的工件数量和交换工件的距离有关，时间复杂度为，当工件数量规模增大的时候，交换较远距离的工件，需要重新计算的工件数量会很多，会消耗较长的时间，因此限制交换距离在交换动作邻域中显得更加重要。

### 多扰动机制

在3.2.1节中提到，区别于传统的迭代局部搜索算法，本文提出了一种带多扰动机制的迭代局部搜索算法（ILS-MP），采用了三种不同的扰动策略，分别是基于禁忌的扰动、基于构造的扰动以及完全随机性的扰动。

基于禁忌的扰动指的是通过迭代固定代数的禁忌搜索来进行扰动。禁忌搜索和局部搜索的过程是类似的，同样是搜索邻域找到邻域最优解替换当前解，但区别在于禁忌搜索会通过禁忌表来记录已经执行过的邻域动作，由于进行扰动的时候，ILS-MP已经陷入了局部最优，禁忌搜索并不会找到更优的局部解，所以禁忌搜索会用当前非禁忌的最好邻域解来替代，即便此解比当前解要差。由于禁忌表的存在，搜索过程会增加一定的疏散性，也正因如此，以这种方式来对解进行扰动，可以起到积极的效果。禁忌搜索可以接受非禁忌的差解，可以在陷入局部最优之后“绕过山坡”，到达新的搜索路径。基于禁忌的扰动可以根据禁忌表的筛选规则，尽量选择不被禁忌的解来迭代，达到扩展邻域搜索空间的目的。同样地，和之前描述的局部搜索过程类似，基于禁忌的扰动中使用的局部动作也是采用的插入动作和交换动作，在每次迭代过程都会按概率选择某一种邻域动作，故而在进行禁忌搜索扰动的时候，需要两张表来作为禁忌表，分别记录插入和交换的邻域动作。具体地，在每一次迭代的时候，如果某个工件从当前位置移动到新位置（可能是插入动作也可能是交换动作），则该工件又回到位置的动作显然是不允许的，这会使解回到以前搜索过的结构，浪费搜索时间。从图XXX中可以看到，插入动作会导致和中间一系列工件的位置发生变化，但因为中间的位置变化是“被迫”产生的，因此只会讲“主动”工件的位置变化加入到禁忌表中。而对于图XX中的交换邻域动作，仅仅和这两个工件的位置发生了变化，这两个工件的原位置就会被加入禁忌表，短时间内不允许回到原位置。为了使ILS-MP更加灵活，本文针对插入动作和交换动作设计了两种不同的禁忌长度，这是因为考虑到禁忌长度应该和不同动作的距离限制有关，因为该值直接决定了邻域空间的大小，禁忌长度是和邻域空间大小强相关的。具体设置的禁忌长度如下：

无论是对于插入动作还是交换动作，禁忌长度都由两部分组成，这也是一般构建禁忌表的做法。一部分是局部搜索中各个动作的距离限制，对于某一个算例来说，它是固定值；另一部分是随机值，大小不超过限制距离的大小，这两部分是线性相关的，通过和两个线性系数构建了每一个禁忌表中每一项不同的禁忌长度。当然，基于禁忌的扰动中还存在一种藐视准则，即如果邻域解虽然被禁忌，但其目标函数值优于当前找到的最优解，该解会被解禁，毕竟局部搜索的目的就在于找到更优质的解。

基于构造的扰动

# 实验结果比较和分析

## 实验方案设计

### 测试算例

### 实验环境

## 参数设定

## 实验结果对比

# 总结与展望

## 对启发式算法的理解

## 启发式算法的发展前景

# 致谢

# 参考文献

1. 华为任正非2016年在全国科技创新大会上的汇报开篇发言 [↑](#footnote-ref-1)