Optimierung

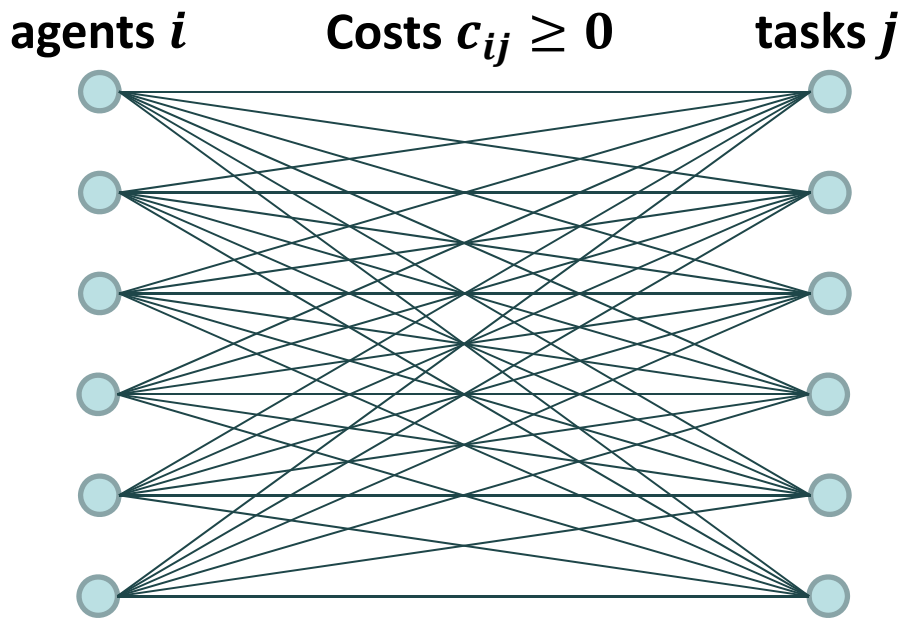
Vorlesung 9

Lineare Programmierung & Kombinatorische Optimierung

© 2013 Fabian Kuhn

Assignment Problem (Zuordnungsproblem)

Gewichtetes Perfektes Bipartites Matching



- Weise jedem Agenten genau eine Aufgabe zu
- Minimiere Gesamtkosten
- Kombinatorisches Optimierungsproblem:
  - Zulässige Lösungen: Kantenmengen, so dass jeder Agent und jede Aufgabe Knoten genau einer der Kanten ist

© 2013 Fabian Kuhn

Assignment Problem (Zuordnungsproblem)

Als $n \times n$-Matrix:

3.2	4.1	1.0	0.4	4.8	2.1
2.3	2.3	0.3	5.1	2.3	3.3
3.0	4.1	1.3	2.9	1.8	2.7
1.7	3.1	1.9	7.4	1.3	9.0
2.3	0.3	0.3	5.1	2.3	2.0
4.1	4.3	4.4	6.1	1.9	2.5

- Wähle genau eine Zelle pro Zeile und Spalte aus
- Minimiere Gesamtkosten (oder maximiere Gesamtgewicht)
- Kombinatorisches Optimierungsproblem:
  - Zulässige Lösungen: n Zellen, so dass jede Zeile und Spalte genau einmal gewählt ist

© 2013 Fabian Kuhn

Assignment Problem (Zuordnungsproblem)

Als Integer Linear Program:

- Variablen $x_{ij} \in \{0,1\}$, $x_{ij} = 1$ falls Zeile i und Spalte j Zelle der Lsg.
  - Falls Agent i Aufgabe j bekommt
- Zuordnungsproblem:

$$\min \sum_{i,j} c_{ij} x_{ij}$$

$$\forall i \in \{1, \dots, n\}: \sum_{j=1}^{n} x_{ij} = 1$$

$$\forall j \in \{1, \dots, n\}: \sum_{i=1}^{n} x_{ij} = 1$$

$$\forall i, j: \; x_{ij} \in \{0,1\}$$

- Lineares Programm ausser der Bedingung $x_{ij} \in \{0,1\}$

© 2013 Fabian Kuhn

LP Relaxierung

- Schreibe Assignment Problem als lineares Programm:

$$\min \sum_{i,j} c_{ij} x_{ij}$$

$$\forall i \in \{1, \dots, n\}: \sum_{j=1}^{n} x_{ij} = 1$$

$$\forall j \in \{1, \dots, n\}: \sum_{i=1}^{n} x_{ij} = 1$$

$$\boldsymbol{\forall i, j: \ x_{ij} \geq 0}$$

- Nimm x_{ij}-Anteil der Zelle (i, j)
- Summe der Anteile in jeder Zeile/Spalte ist 1
- Vergrössert den Raum der zulässigen Lösungen
- Optimale Lösung ist untere Schranke für optimale Lösung des Ursprungsproblems

© 2013 Fabian Kuhn

Ganzzahlige Lösungen

Satz: Jede nicht-ganzzahlige Lösung kann in eine ganzzahlige Lösung mit gleichen oder besseren Gesamtkosten transformiert werden.

Cost: 3 $x_{11} = 0.2$	Cost: 1 $x_{12} = 0.5$	Cost: 4 $x_{13} = 0$	Cost: 2 $x_{14} = 0.3$
Cost: 2 $x_{21} = 0.3$	Cost: 3 $x_{22} = 0$	Cost: 2 $x_{23} = 0.4$	Cost: 3 $x_{24} = 0.3$
Cost: 1 $x_{31} = 0.5$	Cost: 1 $x_{32} = 0.5$	Cost: 1 $x_{33} = 0$	Cost: 2 $x_{34} = 0$
Cost: 3 $x_{41} = 0$	Cost: 3 $x_{42} = 0$	Cost: 2 $x_{43} = 0.6$	Cost: 1 $x_{44} = 0.4$

© 2013 Fabian Kuhn

Ganzzahlige Lösungen

Satz: Jede nicht-ganzzahlige Lösung kann in eine ganzzahlige Lösung mit gleichen oder besseren Gesamtkosten transformiert werden.

Cost: 3 $x_{11} = \mathbf{0}$	Cost: 1 $x_{12} = \mathbf{0.7}$	Cost: 4 $x_{13} = 0$	Cost: 2 $x_{14} = 0.3$
Cost: 2 $x_{21} = 0.3$	Cost: 3 $x_{22} = 0$	Cost: 2 $x_{23} = 0.4$	Cost: 3 $x_{24} = 0.3$
Cost: 1 $x_{31} = \mathbf{0.7}$	Cost: 1 $x_{32} = \mathbf{0.3}$	Cost: 1 $x_{33} = 0$	Cost: 2 $x_{34} = 0$
Cost: 3 $x_{41} = 0$	Cost: 3 $x_{42} = 0$	Cost: 2 $x_{43} = 0.6$	Cost: 1 $x_{44} = 0.4$

© 2013 Fabian Kuhn

Ganzzahlige Lösungen

Satz: Jede nicht-ganzzahlige Lösung kann in eine ganzzahlige Lösung mit gleichen oder besseren Gesamtkosten transformiert werden.

Cost: 3 $x_{11} = 0$	Cost: 1 $x_{12} = 0.7$	Cost: 4 $x_{13} = 0$	Cost: 2 $x_{14} = 0.3$
Cost: 2 $x_{21} = 0.3$	Cost: 3 $x_{22} = 0$	Cost: 2 $x_{23} = \mathbf{0.7}$	Cost: 3 $x_{24} = \mathbf{0}$
Cost: 1 $x_{31} = 0.7$	Cost: 1 $x_{32} = 0.3$	Cost: 1 $x_{33} = 0$	Cost: 2 $x_{34} = 0$
Cost: 3 $x_{41} = 0$	Cost: 3 $x_{42} = 0$	Cost: 2 $x_{43} = \mathbf{0.3}$	Cost: 1 $x_{44} = \mathbf{0.7}$

© 2013 Fabian Kuhn

Ganzzahlige Lösungen

Satz: Jede nicht-ganzzahlige Lösung kann in eine ganzzahlige Lösung mit gleichen oder besseren Gesamtkosten transformiert werden.

Cost: 3 $x_{11} = 0$	Cost: 1 $x_{12} = 1$	Cost: 4 $x_{13} = 0$	Cost: 2 $x_{14} = 0$
Cost: 2 $x_{21} = 0$	Cost: 3 $x_{22} = 0$	Cost: 2 $x_{23} = 1$	Cost: 3 $x_{24} = 0$
Cost: 1 $x_{31} = 1$	Cost: 1 $x_{32} = 0$	Cost: 1 $x_{33} = 0$	Cost: 2 $x_{34} = 0$
Cost: 3 $x_{41} = 0$	Cost: 3 $x_{42} = 0$	Cost: 2 $x_{43} = 0$	Cost: 1 $x_{44} = 1$

Allgemein:

- Es gibt immer einen Zyklus, so dass man alternierend um den gleichen Betrag erhöhen, reduzieren kann und die Kosten nicht steigen
  - Vgl: alternierende Pfade bei Matching-Formulierung

© 2013 Fabian Kuhn

Lösung Assignment Problem

Mögliche Lösung des Assignment Problems:

1. Löse LP Relaxierung (LP mit $x_{ij} \geq 0$)
2. Mache Lösung ganzzahlig

Mit Simplex-Algorithmus:

- Der Simplex-Algorithmus gibt immer einen Extremalpunkt des konvexen Polyeders, welches durch die lin. Nebenbed. definiert ist.
- Mann kann zeigen: Alle Extremalpunkte des Assignment-Problems sind ganzzahlig
- Der Simplex-Algorithmus gibt direkt eine optimale ganzzahlige Lösung!

Ungarische Methode:

- Schnellerer Algorithmus, spezifisch für das Assignment Problem

© 2013 Fabian Kuhn

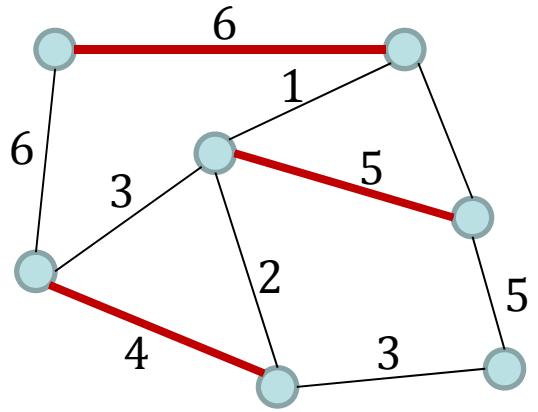
Kombinatorische Optimierung und LPs

Viele wichtige kombinatorische Optimierungsprobleme lassen sich als "Integer"-Varianten von linearen Programmen schreiben.

Assignment Problem (min gewichtetes perfektes Matching im $K_{n,n}$)

Maximum (Weighted) Matching:

- Gegeben ein (gewichteter) Graph $G = (V, E)$
- Matching: Teilmenge der Kanten, so dass sich keine 2 berühren
- Finde Matching mit maximalem Gewicht

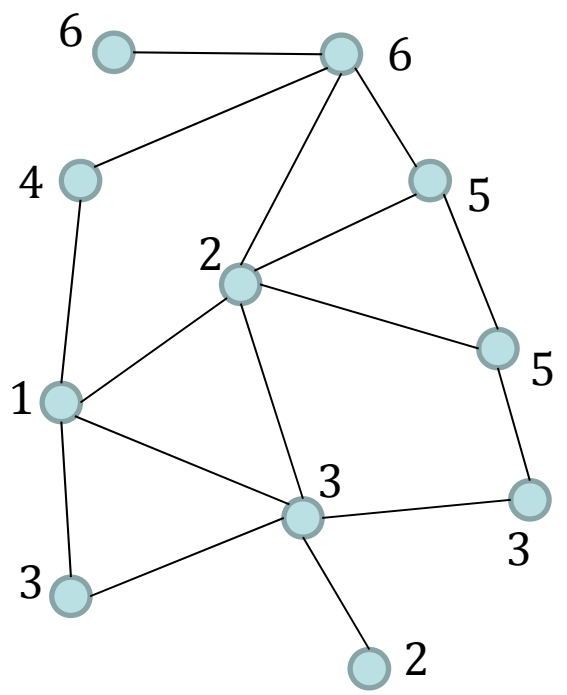


© 2013 Fabian Kuhn

Vertex Cover

Maximum (Weighted) Vertex Cover ():

- Gegeben ein Graph $G = (V, E)$ mit Knotengewichten
- Vertex Cover: Teilmenge der Knoten, so dass jede Kante abgedeckt ist
- Finde Vertex Cover mit minimalem Gewicht



© 2013 Fabian Kuhn

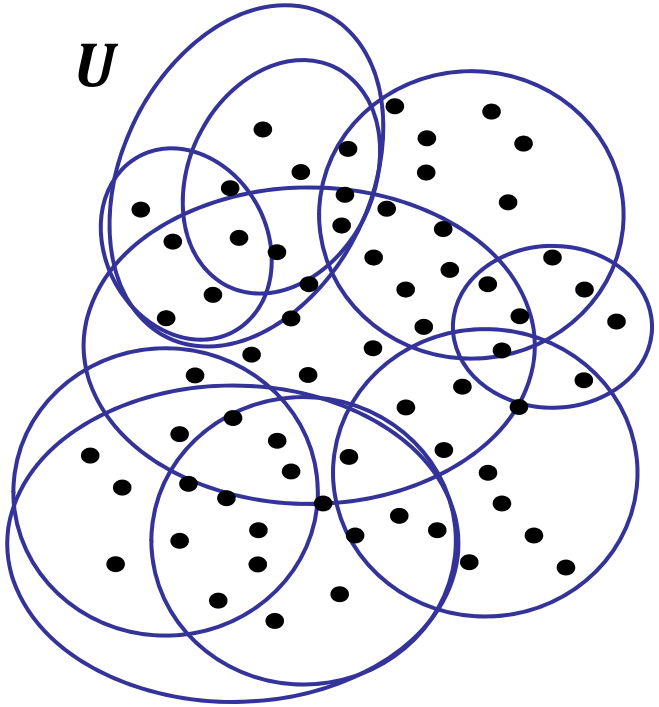
Vertex Cover und Matching ungewichtet:

Set Cover

(Gewichtetes) Set Cover:

- Gegeben: Menge U und Menge von Teilmengen $\mathcal{S} \in 2^U$

- Jede Menge $S \in \mathcal{S}$ hat ein Gewicht c_S
- Set Cover: Teilmenge von $\mathcal{S}$, so dass alle Elemente $u \in U$ abgedeckt sind
- Ziel: Set Cover mit minimalem Gewicht

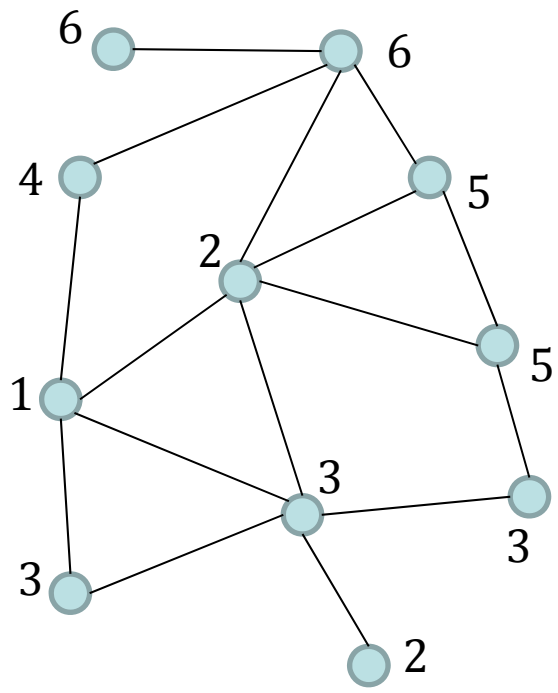


© 2013 Fabian Kuhn

Independent Set

Maxium (gewichtetes) Independent Set (Stabile Menge):

- Gegeben Graph $G = (V, E)$ mit Knotengewichten
- Independent Set (unabhängige/stabile Menge):
  Teilmenge der Knoten, so dass keine 2 adjazent sind
- Ziel: Finde independent set mit maximalem Gewicht



© 2013 Fabian Kuhn

Maximaler Fluss

Flow Network:

- Directed graph $G = (V, E)$, $E \subseteq V^2$
- Each (directed) edge e has a capacity $c_e \geq 0$
  - Amount of flow (traffic) that the edge can carry
- A single source node $s \in V$ and a single sink node $t \in V$

Flow: (informally)

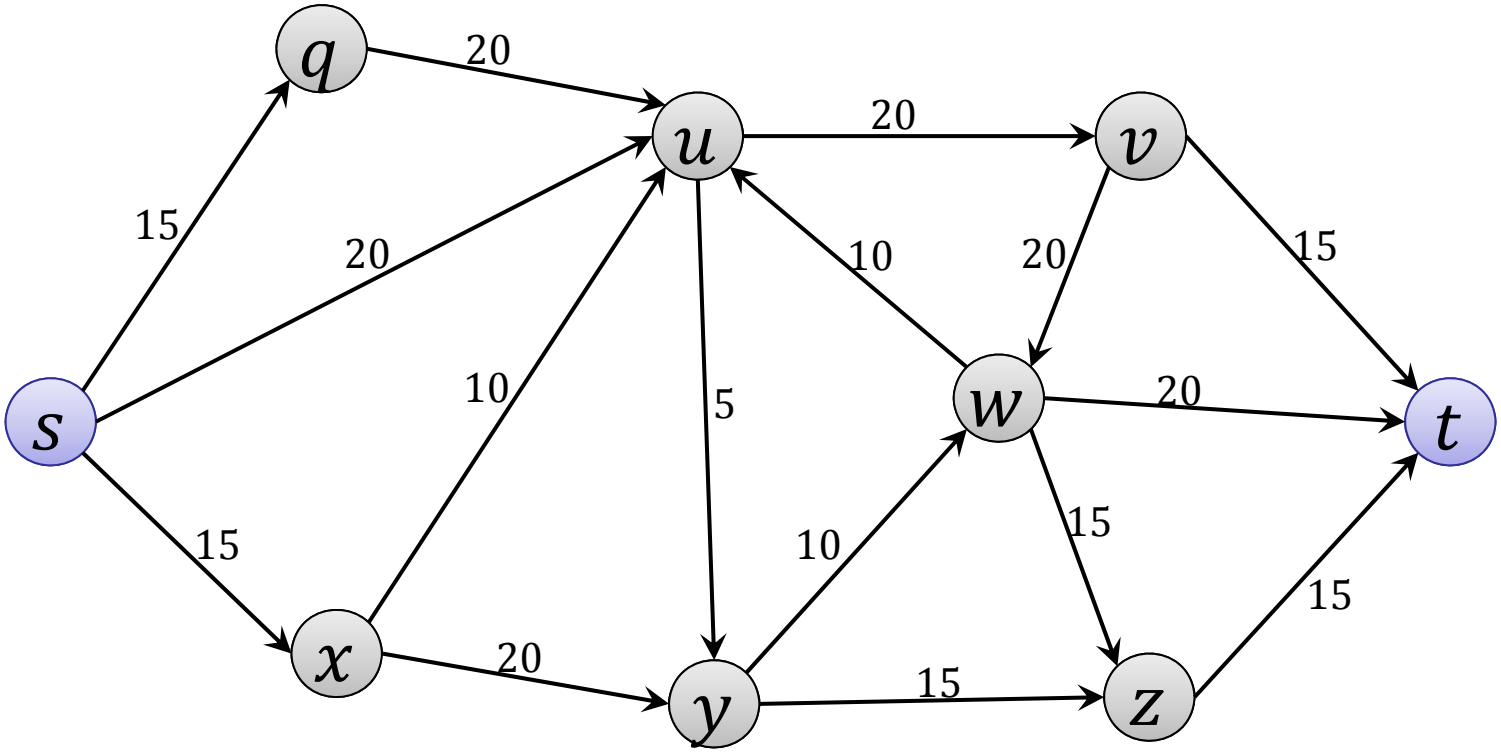
- Traffic from s to t such that each edge carries at most its capacity

Examples:

- Highway system: edges are highways, flow is the traffic
- Computer network: edges are network links that can carry packets, nodes are switches
- Fluid network: edges are pipes that carry liquid

© 2013 Fabian Kuhn

Maximaler Fluss



LP Relaxierung

1. Löse LP Relaxierung (in Polynomialzeit!)
2. Falls möglich: Konvertiere in gleich gute ganzzahlige Lösung

Funktioniert bei:

- **Assignment Problem**
  (Maximum Weighted Matching in bipartiten Graphen)

- **Maximum Integer Flow**

- **Minimum Cost Flow**
  - Anstatt Kapazität, Kantenkosten
  - Erreiche gegebene Vorgaben (für alle Knoten) mit minmalen Kosten
  - Verallgemeinerung des Max Flow Problems

© 2013 Fabian Kuhn

Allgemeines Matching

Matching in allgemeinem Graph $G = (V, E)$

© 2013 Fabian Kuhn

Allgemeines Matching

Zusätzliche Bedingungen:

Knotenmenge S

- Matching kann höchstens $\lfloor |S|/2 \rfloor$ Kanten $\{u, v\}$ mit $u, v \in S$ enthalten
- Variable $x_{u,v} = 1$: Kante $\{u, v\}$ im Matching
- Zusätzlich: Für alle ungeraden Knotenmengen S:

$$\sum_{u,v \in S, \{u,v\} \in E} x_{u,v} \leq \frac{|S| - 1}{2}$$

- Neues LP hat nur ganzzahlige Extremallösungen
- Aber: Exponentielle Anzahl Nebenbedingungen!
- Es gibt einen polynomiellen Algorithmus von Edmonds
  - Alg. findet duale optimale Lösung mit nur polynomiell vielen Variablen, welche nicht Null sind
  - Dient als Zertifikat für die Optimalität

© 2013 Fabian Kuhn

Cutting Planes

Allgemeine Optimierungs-Technik:

1. Formuliere kombinatorisches Problem als Integer LP
2. Relaxiere auf ein LP
3. Löse LP mit Hilfe des Simplex- oder eines anderen Algorithmus
4. Falls Lösung ganzzahlig sind wir fertig
5. Sonst:

   Versuche weitere Nebenbedingungen hinzuzufügen, so dass
   - die momentane Lösung nicht mehr zulässig ist
   - alle ganzzahligen Lösungen weiterhin zulässig sind

© 2013 Fabian Kuhn

Vertex Cover und Maximum Matching (ungewichtet):

Vertex Cover und Maximum Matching (ungewichtet):

Approximationsalgorithmen

Gewichtetes Vertex Cover:

1. Löse LP Relaxierung
2. Runde auf ganzzahlige Lösung:

- Für jede Kante $\{u, v\} \in E$ gilt $x_u + x_v \geq 1$

- Falls $x_u \geq 0.5$, runde x_u auf $x_u = 1$ auf
  Falls $x_u < 0.5$, runde x_u auf $x_u = 0$ ab

- Gibt eine 2-Approximation:

© 2013 Fabian Kuhn

Integer LP und LP Relaxierung

Integrality Gap

- Verhältnis zwischen optimalem Zielfunktionswert des Integer LP und der Relaxierung

Maximum Matching

- Integrality Gap ist mindestens $^3/_2$

Minimum Vertex Cover (ungewichtet)

- Integrality Gap ist mind. $2 - {}^1/_n$ (und höchstens 2)

Maximum Clique (ungewichtet)

- Integrality Gap ist mindestens $n/2$.

© 2013 Fabian Kuhn

Minimum Set Cover (ungewichtet)

Greedy-Algorithmus:

- Füge Menge $S \in \mathcal{S}$ hinzu, welche die meisten neuen Elemente abdeckt

Minimum Set Cover (ungewichtet)

Greedy-Algorithmus:

- Füge Menge $S \in \mathcal{S}$ hinzu, welche die meisten neuen Elemente abdeckt

Minimum Set Cover (ungewichtet)

Greedy-Algorithmus:

- Füge Menge $S \in \mathcal{S}$ hinzu, welche die meisten neuen Elemente abdeckt

Minimum Set Cover (gewichtet)

Randomisiertes Runden:

1. Löse LP Relaxierung
   – Jede Menge $S \in \mathcal{S}$ hat Wert x_S, so dass

$$\forall u \in U: \sum_{S \in \mathcal{S}: u \in S} x_S \geq 1$$

2. Mit Wahrscheinlichkeit $\min\{1, x_S \cdot \ln n\}$ setze $x'_S = 1$ (sonst $x'_S = 0$)

Minimum Set Cover (gewichtet)

Randomisiertes Runden:

1. Löse LP Relaxierung
   – Jede Menge $S \in \mathcal{S}$ hat Wert x_S, so dass

$$\forall u \in U: \sum_{S \in \mathcal{S}: u \in S} x_S \geq 1$$

2. Mit Wahrscheinlichkeit $\min\{1, x_S \cdot \ln n\}$ setze $x'_S = 1$ (sonst $x'_S = 0$)