

## Algoritmos

Pedro Hokama

- [cirs] Algoritmos: Teoria e Prática (Terceira Edição) Thomas H. Cormen, Charles Eric Leiserson, Ronald Rivest e Clifford Stein.
  - [timr] Algorithms Illuminated Series, Tim Roughgarden
  - Desmistificando Algoritmos, Thomas H. Cormen.
  - Algoritmos, Sanjoy Dasgupta, Christos Papadimitriou e Umesh Vazirani
  - Stanford Algorithms  
<https://www.youtube.com/playlist?list=PLXFMmlk03Dt7Q0xr1PIAriY5623cKiH7V>  
<https://www.youtube.com/playlist?list=PLXFMmlk03Dt5EM12s2WQ8sLsZ17A5HEK6>
  - Conjunto de Slides dos Professores Cid C. de Souza, Cândida N. da Silva, Orlando Lee, Pedro J. de Rezende
  - Conjunto de Slides do Professores Cid C. de Souza para a disciplina MO420
- Qualquer erro é de minha responsabilidade.

1 / 63

2 / 63

## Programação Linear

- Já vimos vários problemas de Otimização. Caminho mínimo, Click, Mochila, AGM,...
- Em todos eles procuramos uma solução que:
  - 1 satisfaz certas restrições
  - 2 é a melhor possível, em relação a algum critério bem-definido.

- **Programação Linear** descreve uma ampla classe de problemas em que:
  - 1 as variáveis podem assumir valores  $\mathbb{R}$
  - 2 as restrições são funções lineares.
  - 3 o critério (a função objetivo) é uma função linear.
- Acontece que um enorme número de problemas pode ser expresso desse jeito.

3 / 63

4 / 63

Uma chocolateria faz 2 tipos de chocolates. O tradicional Pyramide, e uma versão gourmet Pyramide Nuit. Quanto de cada caixa produzir para maximizar os lucros?

- Cada caixa de Pyramide gera \$1 de lucro.
- Cada caixa de Nuit gera \$6 de lucro.

Sabemos que conseguimos vender

- no máximo 200 caixas de Pyramide.
- no máximo 300 caixas de Nuit.

Além disso, dada a força de trabalho atual

- podemos produzir no máximo 400 caixas de chocolate.

5 / 63

Vamos chamar de

- $x_1$  a quantidade de caixas de Pyramide, e
- $x_2$  a quantidade de Nuit a serem produzidas.

O que sabemos sobre cada uma dessas quantidades?

- no máximo 200 caixas de Pyramide

$$x_1 \leq 200$$

- no máximo 300 caixas de Nuit

$$x_2 \leq 300$$

6 / 63

- $x_1$  a quantidade de caixas de Pyramide, e
- $x_2$  a quantidade de Nuit a serem produzidas.

Limite de produção:

- podemos produzir no máximo 400 caixas de chocolate.

$$x_1 + x_2 \leq 400$$

Além disso não é possível produzir quantidades negativas.

$$x_1 \geq 0$$

$$x_2 \geq 0$$

7 / 63

- $x_1$  a quantidade de caixas de Pyramide, e
- $x_2$  a quantidade de Nuit a serem produzidas.

Qual será o lucro total?

- Cada caixa de Pyramide gera \$1 de lucro.
- Cada caixa de Nuit gera \$6 de lucro.

$$x_1 + 6x_2$$

8 / 63

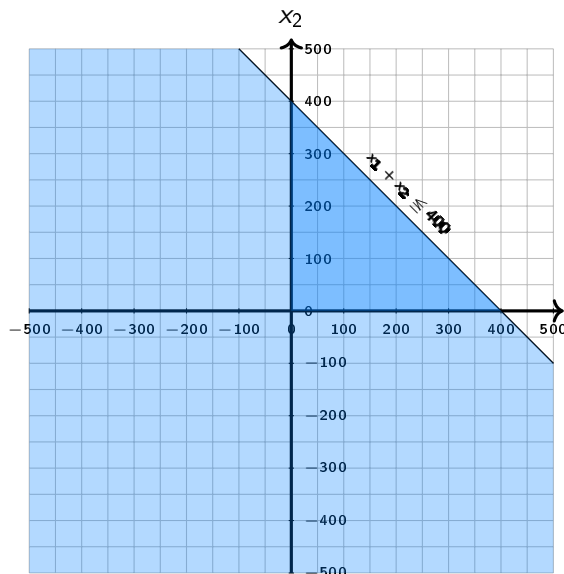
Podemos então escrever o seguinte **Programa Linear** que representa esse problema:

$$\begin{array}{ll} \text{maximizar} & x_1 + 6x_2 \\ \text{sujeito a} & x_1 \leq 200 \\ & x_2 \leq 300 \\ & x_1 + x_2 \leq 400 \\ & x_1 \geq 0 \\ & x_2 \geq 0 \end{array}$$

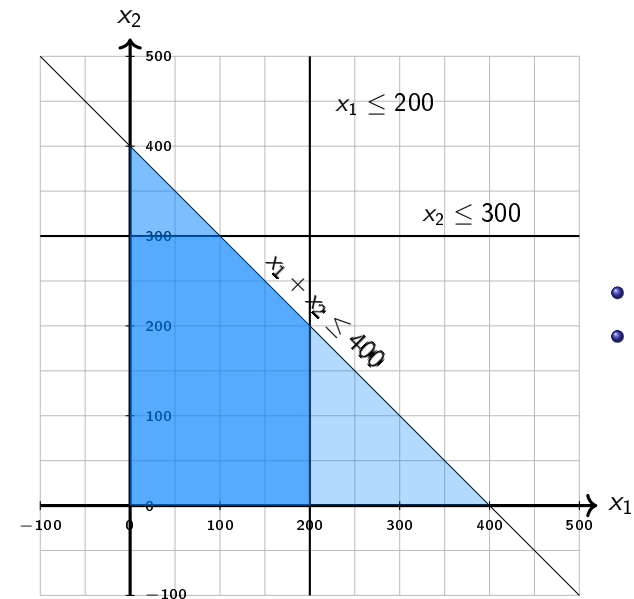
- Uma interpretação geométrica.

9 / 63

10 / 63



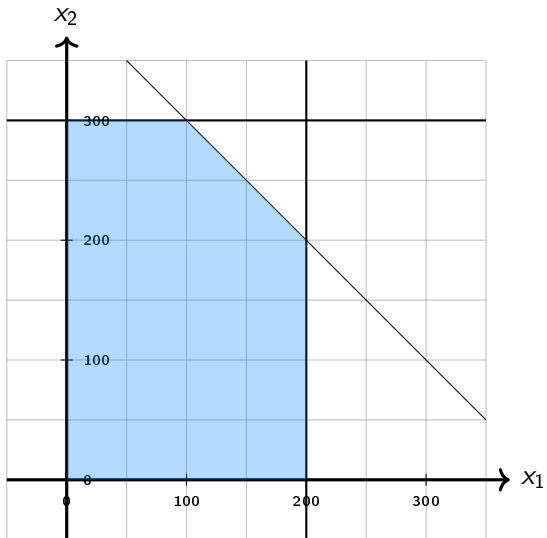
- o que significa  $x_1 + x_2 = 400$
- o que significa  $x_1 + x_2 \leq 400$
- o que significa  $x_1 \geq 0$  e  $x_2 \geq 0$



- $x_1 \leq 200$
- $x_2 \leq 300$

11 / 63

12 / 63



maximizar

$$x_1 + 6x_2$$

sujeito a

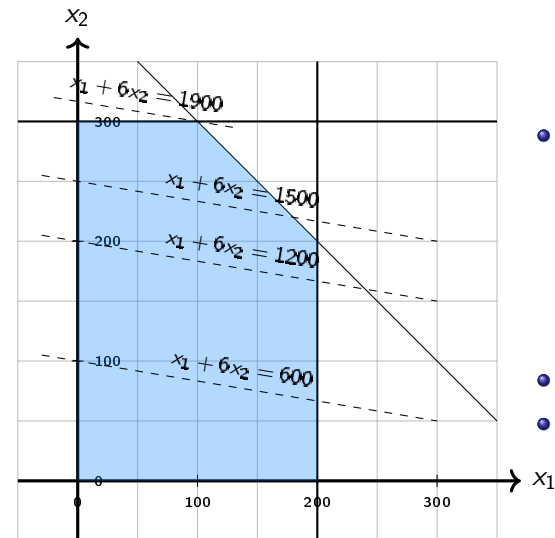
$$x_1 \leq 200$$

$$x_2 \leq 300$$

$$x_1 + x_2 \leq 400$$

$$x_1, x_2 \geq 0$$

Onde será que está a solução ótima?



- Será que conseguimos uma solução de \$600? Ou seja,

$$x_1 + 6x_2 = 600$$

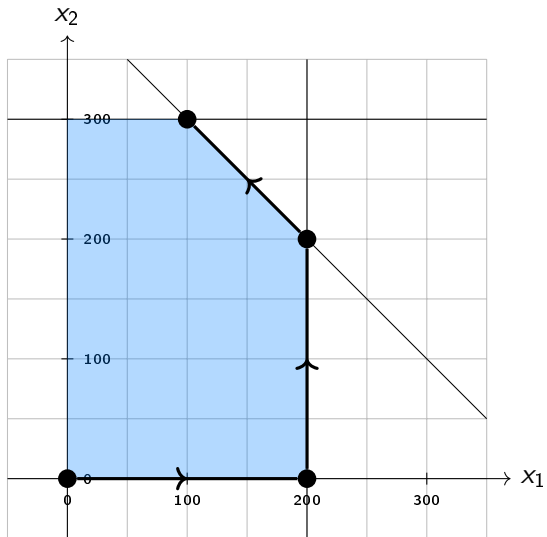
- $x_1 + 6x_2 = 1200$

- $x_1 + 6x_2 = 1500$

- É uma regra geral de programas lineares que sempre existe pelo menos um vértice da região factível que tem uma solução ótima. Exceto quando o ótimo não existe que pode acontecer quando:
  - ▶ O programa é infactível.
  - ▶ A solução é ilimitadamente boa.

### Resolvendo Programas Lineares

- Aproveitando-se do fato de uma solução ótima estar em um vértice. O algoritmo simplex encontra uma solução ótima com a seguinte estratégia:
  - 1 Comece de um vértice inicial qualquer da solução viável.
  - 2 Observe os vértices vizinhos.
  - 3 Se algum vértice for melhor, mova-se para esse vértice e repita.
  - 4 Senão, se nenhum vértice for melhor, já está na solução ótima.



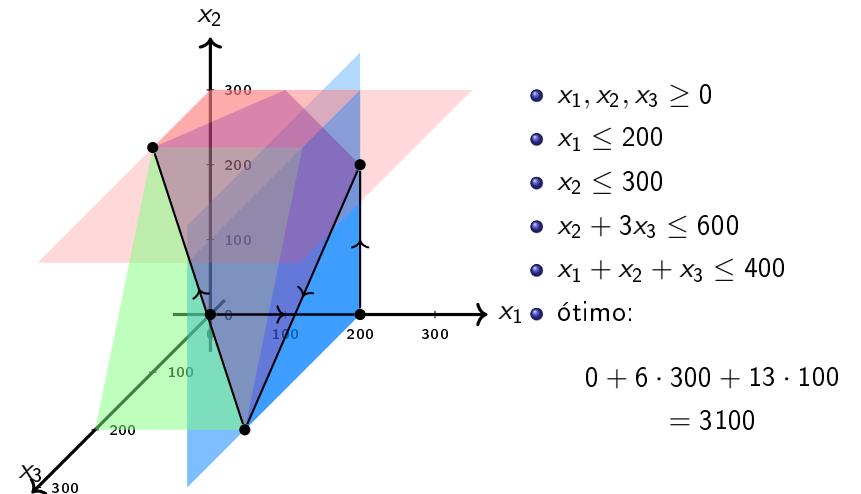
### Mais Produtos

- A chocolateria decide adicionar ao Pyramide e ao Pyramide Nuit, um novo produto ainda mais luxuoso o Pyramide **Luxe**.
- Cada caixa do Luxe dá um lucro de \$13.
- As antigas restrições ainda valem (e agora  $x_3$  também conta no limite de 400 caixas)
- Além disso, Nuit e Luxe usam o mesmo tipo de embalagem, mas enquanto Nuit usa 1, Luxe usa 3. E a chocolateria tem apenas 600 dessas embalagens disponíveis.

17 / 63

18 / 63

$$\begin{array}{ll}
 \text{maximizar} & x_1 + 6x_2 + 13x_3 \\
 \text{sujeito a} & x_1 \leq 200 \\
 & x_2 \leq 300 \\
 & x_1 + x_2 + x_3 \leq 400 \\
 & x_2 + 3x_3 \leq 600 \\
 & x_1, x_2, x_3 \geq 0
 \end{array}$$



19 / 63

20 / 63

- A região factível de um PL é chamado de poliedro.
- Como podemos mostrar que de fato  $(0, 300, 100)$  é uma solução ótima?
- Observe que a solução deve obedecer a desigualdade:

$$\begin{aligned} x_2 + 3x_3 &\leq 600 \quad (\times 4) \\ 4x_2 + 12x_3 &\leq 2400 \end{aligned}$$

$$\begin{array}{r} 4x_2 + 12x_3 \leq 2400 \\ x_1 + x_2 + x_3 \leq 400 \\ \quad \quad x_2 \leq 300 \\ \hline x_1 + 6x_2 + 13x_3 \leq 3100 \end{array}$$

Mas  $x_1 + 6x_2 + 13x_3$  é justamente a função objetivo. Então essa desigualdade que é respeitada por qualquer solução nos diz que nenhuma solução vai ter lucro maior que 3100, como já encontramos uma solução  $(0, 300, 100)$  com lucro 3100 ela com certeza é ótima.

- É possível resolver um outro Programa Linear que irá encontrar esse valor.
- Esse outro PL está intimamente ligado ao PL original e se chama Dual.
- Podemos ter Programas Lineares com 4, 5 ou centenas de variáveis. Nesses casos já não é tão fácil desenhar o poliedro, mas o principio geral é o mesmo.

- George Dantzig (1914 - 2005) foi um cientista matemático norte-americano.
- Fez várias contribuições na engenharia, pesquisa operacional, computação e matemática. Ao chegar atrasado em uma aula, resolveu dois problemas estatísticos, até então em aberto, confundido-os com lição de casa.
- Inventou o algoritmo simplex para Programação Linear em 1947



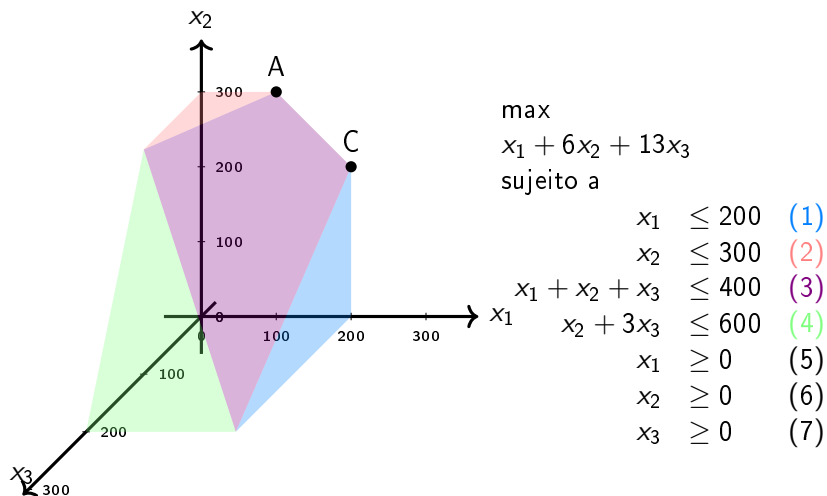
# Algoritmo Simplex

- Vamos começar agora a ver o algoritmo simplex. Primeiramente daremos algumas intuições e definições.
- No espaço  $\mathbb{R}^n$  cada equação linear define um **hiperplano**,
- e cada inequação define um **semi-espaço**,
- a região factível é dada pela intersecção dos semi-espaços,
- e forma um **poliedro convexo** (politopo se for limitado).

- Como o poliedro é convexo, um ótimo local também é um ótimo global.

25 / 63

26 / 63



- O vértice é um ponto único onde um subconjunto de hiperplanos se encontra.
- O ponto A é o único ponto no qual (2), (3) e (7) são satisfeitas com igualdade.
- Por outro lado os hiperplanos (4) e (6) não definem um vértice, porque sua intersecção é uma linha inteira.

Selecione um subconjunto das inequações. Se existir um único ponto que satisfaça todas elas com igualdade, e este ponto for factível, então ele será um vértice.

27 / 63

28 / 63

- Se temos  $n$  variáveis, precisamos de pelo menos  $n$  equações lineares se queremos uma única solução.
- Mais do que  $n$  equações é redundante, e pelo menos uma delas pode ser reescrita como combinação linear das outras, e pode ser descartada.

Cada vértice é especificado por um conjunto de  $n$  inequações.

29 / 63

- Uma noção de vizinho segue naturalmente

Dois vértices são vizinhos se eles têm em comum  $n - 1$  das inequações que os definem.

- Por exemplo, na nossa figura, A e C compartilham as inequações (3) e (7).

30 / 63

- O algoritmo simplex trabalha com um sistema de equações, dessa forma devemos transformar o nosso PL.

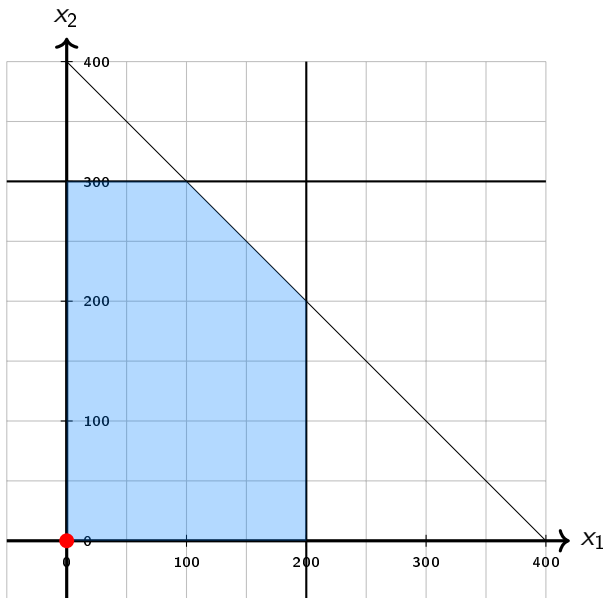
$$\begin{array}{ll}
 \max & x_1 + 6x_2 \\
 \text{sujeito a} & x_1 + s_1 \leq 200 \\
 & x_2 + s_2 \leq 300 \\
 & x_1 + x_2 + s_3 \leq 400 \\
 & x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0
 \end{array}$$

31 / 63

- Iremos dividir nossas variáveis em duas partes, vamos chamar de variáveis **na base** aquelas com algum valor e variáveis **fora da base** aquelas que são iguais a zero.
- Escrevemos as variáveis na base em função das variáveis fora da base.
- Vamos começar com as variáveis de folga na base e as variáveis  $x_1$  e  $x_2$  fora da base (ou seja, iguais a zero, e portanto estamos falando do vértice na origem).

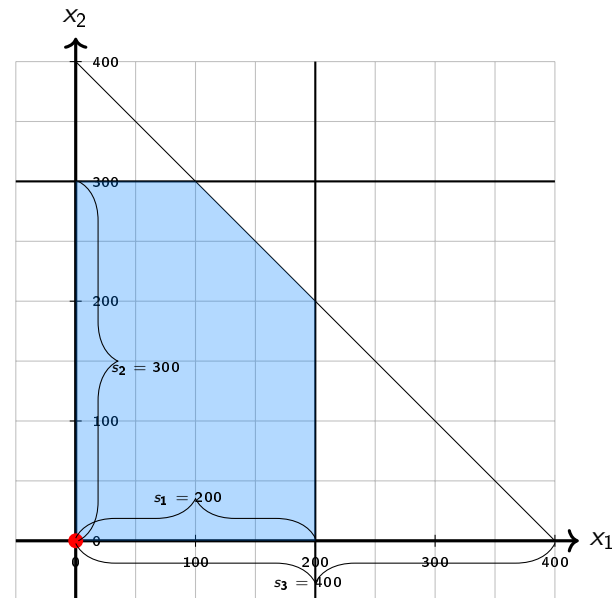
32 / 63





maximizar  
 $x_1 + 6x_2$   
 sujeito a  
 $s_1 = 200 - x_1$   
 $s_2 = 300 - x_2$   
 $s_3 = 400 - x_1 - x_2$   
 $x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$

- agora olhe para a função objetivo, alguma tem coeficiente positivo? Isso significa que vale a pena aumentar aquela variável.



- intuitivamente o valor das variáveis de folga (com os devidos ajustes) significa a distância que estamos de cada uma das restrições

- como  $x_1$  tem coeficiente positivo na função objetivo, vamos aumentar o valor dela (colocar ela na base), mas para isso precisamos tirar alguém da base.
- seja  $b_i$  o valor da constante da equação  $i$ , e seja  $a_{i1}$  o valor do coeficiente de  $x_1$  na equação  $i$ . Vamos procurar o  $\frac{b_i}{-a_{i1}}$  mínimo

maximizar  
 $x_1 + 6x_2$   
 sujeito a

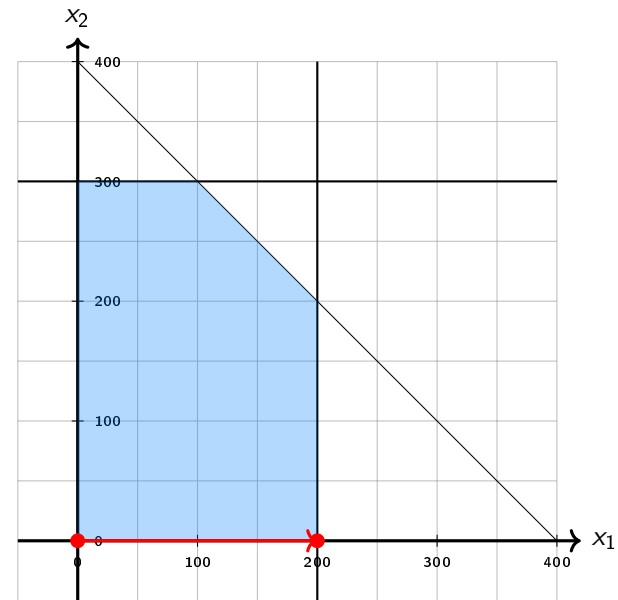
$$s_1 = 200 - x_1 \quad \frac{b_1}{-a_{11}} = \frac{200}{-(-1)} = 200$$

$$s_2 = 300 - x_2 \quad \frac{b_2}{-a_{21}} = \frac{300}{0}$$

$$s_3 = 400 - x_1 - x_2 \quad \frac{b_3}{-a_{31}} = \frac{400}{-(-1)} = 400$$

$x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$

maximizar  
 $(200 - s_1) + 6x_2$   
 sujeito a  
 $x_1 = 200 - s_1$   
 $s_2 = 300 - x_2$   
 $s_3 = 400 - (200 - s_1) - x_2$   
 $x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$



- $x_1$  era zero, foi para 200
- note que se escolhêssemos  $s_3$  para sair da base, sairíamos da região viável.

37 / 63

38 / 63

maximizar  
 $200 - s_1 + 6x_2$   
 sujeito a  
 $x_1 = 200 - s_1 \quad \frac{b_1}{-a_{12}} = \frac{200}{0}$   
 $s_2 = 300 - x_2 \quad \frac{b_2}{-a_{22}} = \frac{300}{-(-1)} = 300$   
 $s_3 = 200 + s_1 - x_2 \quad \frac{b_3}{-a_{32}} = \frac{200}{-(-1)} = 200$   
 $x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$

maximizar  
 $200 - s_1 + 6x_2$   
 sujeito a  
 $x_1 = 200 - s_1$   
 $s_2 = 300 - x_2$   
 $x_2 = 200 + s_1 - s_3$   
 $x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$

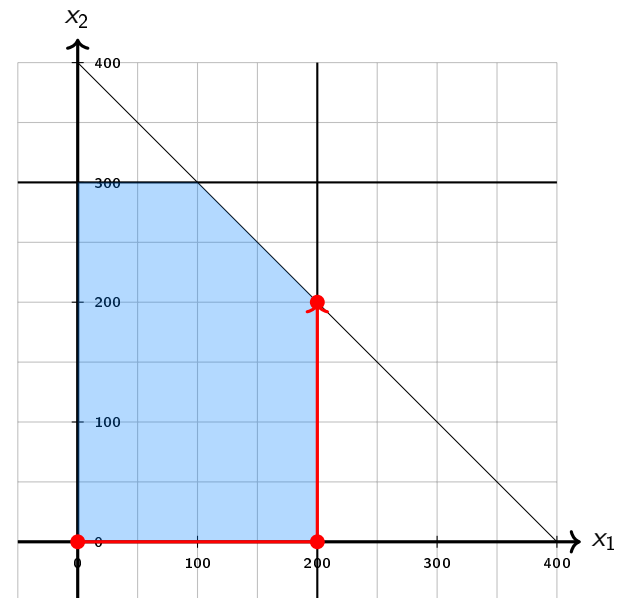
39 / 63

40 / 63

maximizar  
 $200 - s_1 + 6(200 + s_1 - s_3)$   
 sujeito a  
 $x_1 = 200 - s_1$   
 $s_2 = 300 - (200 + s_1 - s_3)$   
 $x_2 = 200 + s_1 - s_3$   
 $x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$

maximizar  
 $200 - s_1 + 1200 + 6s_1 - 6s_3$   
 sujeito a  
 $x_1 = 200 - s_1$   
 $s_2 = 300 - 200 - s_1 + s_3$   
 $x_2 = 200 + s_1 - s_3$   
 $x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$

maximizar  
 $1400 + 5s_1 - 6s_3$   
 sujeito a  
 $x_1 = 200 - s_1$   
 $s_2 = 100 - s_1 + s_3$   
 $x_2 = 200 + s_1 - s_3$   
 $x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$



- $x_2$  era zero, foi para 200
- note que tirar  $s_3$  da base, significa zerar a distância até a restrição 3.

maximizar

$1400 + 5s_1 - 6s_3$  coef. de  $s_1$  é positivo

sujeito a

$$x_1 = 200 - s_1 \quad \frac{200}{-(-1)} = 200$$

$$s_2 = 100 - s_1 + s_3 \quad \frac{100}{-(-1)} = 100$$

$$x_2 = 200 + s_1 - s_3 \quad \frac{200}{-1} = -200$$

$$x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$$

precisamos escolher o menor coeficiente positivo

45 / 63

maximizar

$1400 + 5s_1 - 6s_3$

sujeito a

$$x_1 = 200 - s_1$$

$$s_1 = 100 - s_2 + s_3$$

$$x_2 = 200 + s_1 - s_3$$

$$x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$$

46 / 63

maximizar

$1400 + 5(100 - s_2 + s_3) - 6s_3$

sujeito a

$$x_1 = 200 - (100 - s_2 + s_3)$$

$$s_1 = 100 - s_2 + s_3$$

$$x_2 = 200 + (100 - s_2 + s_3) - s_3$$

$$x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$$

47 / 63

maximizar

$1400 + 500 - 5s_2 + 5s_3 - 6s_3$

sujeito a

$$x_1 = 200 - 100 + s_2 - s_3$$

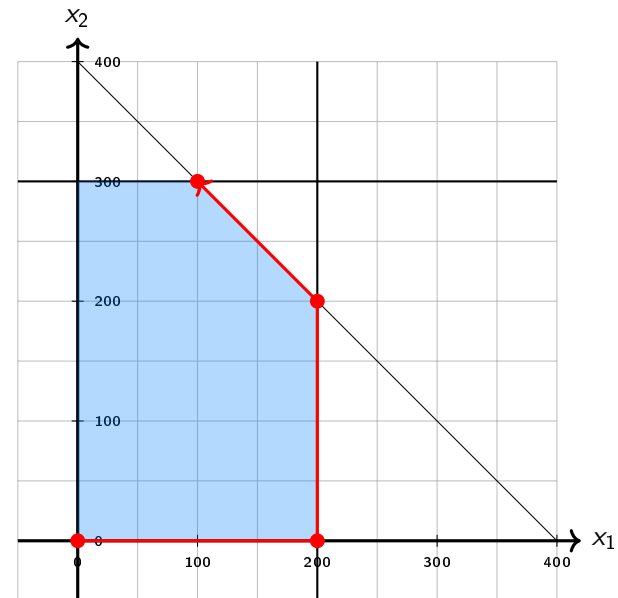
$$s_1 = 100 - s_2 + s_3$$

$$x_2 = 200 + 100 - s_2 + s_3 - s_3$$

$$x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$$

48 / 63

maximizar  
 $1900 - 5s_2 - s_3$   
 sujeito a  
 $x_1 = 100 + s_2 - s_3$   
 $s_1 = 100 - s_2 + s_3$   
 $x_2 = 300 - s_2$   
 $x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$



- $x_1$  era 200, foi para 100
- $x_2$  era 200, foi para 300
- note que tirar  $s_2$  da base, significa zerar a distância até a restrição 2.

## Bibliotecas

como nenhum coef. é positivo não vale a pena aumentar  
 maximizar  
 $1900 - 5s_2 - s_3$   
 sujeito a  
 $x_1 = 100 + s_2 - s_3$   
 $s_1 = 100 - s_2 + s_3$   
 $x_2 = 300 - s_2$   
 $x_1, x_2, s_1, s_2, s_3 \geq 0$

- Felizmente existem várias bibliotecas que implementam o simplex (e várias formas de resolução) para resolver PLs (e outras modelagens matemáticas)
- Talvez as mais conhecidas sejam:
  - ▶ IBM CPLEX Optimization Studio (comercial)
  - ▶ Gurobi Solver (comercial)
  - ▶ Google OR-Tools (open source)
  - ▶ GLPK (open source)

## OR-Tools

- É uma ferramenta de código aberto para otimização combinatória.
- Em geral, o objetivo é encontrar a melhor solução para um problema em um conjunto muito grande de soluções possíveis.

53 / 63

- Exemplos de problemas que podem ser resolvidos com o OR-Tools:
  - ▶ Roteamento de Veículos: Encontrar as melhores rotas para uma frota de veículos que coletam e entregam pacotes dadas algumas restrições ("um caminhão não pode carregar mais do que 23 toneladas", "todas as entregas devem ser feitas dentro de uma janela de 8 horas", etc)
  - ▶ Escalonamento: Encontrar o escalonamento (agendamento) ótimo para um conjunto complexo de tarefas, sujeito a algumas restrições ("algumas atividades precisam ser executadas antes de outras atividades", "algumas atividades podem compartilhar um mesmo recurso", etc)
  - ▶ *Bin packing*: Empacotar vários objetos pequenos em recipientes, minimizando o número de recipientes necessários.

54 / 63

## OR-Tools

OR-Tools inclui resolvedores:

- Programação por Restrições.
- Programação Linear.
- Programação Linear Inteira Mista.
- Roteamento de Veículos.
- Algoritmos em Grafos (caminho mais curto, fluxo de custo mínimo, fluxo máximo, etc)

55 / 63

## OR-Tools

OR-Tools é escrito em C++, mas também pode ser usado com Python, Java ou C#.

- Link para instalação: <https://developers.google.com/optimization/install/cpp>
- Meu sistema é o Linux Mint 19.3 Tricia, então baixei a versão do OR-Tools para Ubuntu 18.04
- Link para vários exemplos: <https://developers.google.com/optimization/examples>

56 / 63

```

maximize 3x + y,
sujeito a x + y ≤ 2,
          0 ≤ x ≤ 1,
          0 ≤ y ≤ 2.

```

```

maximize 3x + y,
sujeito a x + y ≤ 2,
          0 ≤ x ≤ 1,
          0 ≤ y ≤ 2.

```

```

#include "ortools/linear_solver/linear_solver.h"
using namespace operations_research;
int main() {
    // Criar o Resolvedor, que usa o GLOP
    MPSolver solver("simple_lp_program",
                   MPSolver::GLOP_LINEAR_PROGRAMMING);

    // Criar as variaveis x e y, ja dizendo o tipo,
    // os limitantes, e um nome
    MPVariable* const x = solver.MakeNumVar(0.0, 1, "x");
    MPVariable* const y = solver.MakeNumVar(0.0, 2, "y");

```

57 / 63

58 / 63

```

maximize 3x + y,
sujeito a x + y ≤ 2,
          0 ≤ x ≤ 1,
          0 ≤ y ≤ 2.

```

```

// Criar a restricao, 0 <= x + y <= 2.
MPConstraint* const ct = solver.MakeRowConstraint(0.0,
2.0, "ct");
ct->SetCoefficient(x, 1);
ct->SetCoefficient(y, 1);
// Criar a funcao objetivo, 3 * x + y.
MPObjective* const objective = solver.MutableObjective();
objective->SetCoefficient(x, 3);
objective->SetCoefficient(y, 1);
objective->SetMaximization();

```

```

maximize 3x + y,
sujeito a x + y ≤ 2,
          0 ≤ x ≤ 1,
          0 ≤ y ≤ 2.

```

```

// Resolver!
solver.Solve();

std::cout << "Solution:" << std::endl;
std::cout << "Objective value = " << objective->Value()
           << std::endl;
std::cout << "x = " << x->solution_value() << std::endl;
std::cout << "y = " << y->solution_value() << std::endl;
return EXIT_SUCCESS;
}

```

59 / 63

60 / 63

```
hokama@fanatico:~$ cd /opt/or-tools_Ubuntu-18.04-64bit_v7.6.7691/
hokama@fanatico:~/opt/or-tools_Ubuntu-18.04-64bit_v7.6.7691$ make run SOURCE=/home/hokama/cic111/teste.cc
g++ -fPIC -std=c++11 -O4 -DNDEBUG -Iinclude -I. -DARCH_K8 -Wno-deprecated -DUSE_CBC -DUSE_CLP -DUSE_BOP -DUSE_GL
OP \
objs/teste.o \
-Llib -Llib64 -lprotobuf -lglog -lgflags -lcbsolver -lcbc -losicbc -lcgl -lclpSolver -lclp -losiclp -losi -lco
inUtils -lortools -Wl,-rpath,"$ORIGIN" -Wl,-rpath,"$ORIGIN/../lib64" -Wl,-rpath,"$ORIGIN/../lib" -lz -lrt -lp
thread \
-o bin/teste
bin/teste
Solution:
Objective value = 4
x = 1
y = 1
hokama@fanatico:~/opt/or-tools_Ubuntu-18.04-64bit_v7.6.7691$
```

Exercício: Modelar o seguinte problema:

### Problema do fluxo máximo

Dado um grafo direcionado  $D = (V, A)$  em que cada arco  $(u, v) \in A$  tem uma capacidade  $c_{(u,v)}$ , um vértice fonte  $s \in V$  e um vértice sorvedouro  $t \in V$ .

Desejamos encontrar um fluxo máximo de  $s$  até  $t$ , sendo que em todos os vértices exceto  $s$  e  $t$  a quantidade de fluxo que entra deve ser igual a quantidade de fluxo que sai, e as capacidades dos arcos são respeitadas.

