

Задача о ближайшем соседе

Дано: функция $f(x, y) \geq 0$ — затраты на обслуживание отрезка дороги от x до y , $0 \leq x \leq y \leq M$, x, y — целочисленные точки, n — число отрезков.

Найти: оптимальное разбиение сегмента $[0, M]$ на n отрезков.

Математическая модель:

$$\min \sum_{k=1}^n f(x_{k-1}, x_k)$$
$$0 = x_0 \leq \dots \leq x_n = M$$

Алгоритм динамического программирования

$S_k(y)$ — минимальные затраты на обслуживание k отрезков для сегмента $[0, y]$.

Рекуррентные соотношения:

$$S_1(y) = f(0, y), \quad y = 1, \dots, M$$

$$S_k(y) = \min_{1 \leq x \leq y} \{S_{k-1}(x) + f(x, y)\}, \quad y = 1, \dots, M, \quad k = 2, \dots, n.$$

$$T = O(nM^2) \quad \Pi = O(nM)$$

Оптимизация числа отрезков

Для каждого $n = 1, \dots, M$ найти $S_n(M)$ и выбрать наименьшее значение $T = O(M^3)$, $\Pi = O(M^2)$.

Модифицированный вариант

$\tilde{S}(y)$ — минимальные затраты на обслуживание сегмента $[0, y]$.

Рекуррентные соотношения:

$$\tilde{S}(0) = 0,$$

$$\tilde{S}(y) = \min_{0 \leq x \leq y-1} \{\tilde{S}(x) + f(x, y)\}, \quad y = 1, \dots, M.$$

$$T = O(M^2), \quad \Pi = O(M).$$

Задача замены оборудования

Приведение затрат к начальному моменту

Пусть χ — банковский процент, или коэффициент эффективности капиталовложений (годовая норма дисконта).

Если S_1 — капитал в начальный год, то по истечении года эта сумма станет равной $S_2 = S_1 \cdot (1 + \chi)$, а в конце t -го года $S_t = S_1 \cdot (1 + \chi)^{t-1}$.

Если в год t хотим потратить сумму S_t , то в начальный год должны иметь

$S_1 = \frac{S_t}{(1 + \chi)^{t-1}}$. Затраты S_t в год t , будучи приведенными к началу

ту $t=1$, равны

$$\tilde{S} = \alpha^{t-1} \cdot S_t,$$

где $\alpha = \frac{1}{1 + \chi}$ — коэффициент дисконтирования, $0 < \alpha \leq 1$.

Если в течении T лет производились траты S_1, S_2, \dots, S_t то суммарные приведенные затраты вычисляются по формуле:

$$\tilde{S} = \sum_{t=1}^T \alpha^{t-1} S_t.$$

Пример Рассмотрим распределение капитала в 8 млн. руб. в течение 8 лет при банковском проценте $\chi = 0.1$ ($\alpha = 0.91$) и трех стратегиях:

- 1) все траты в 1-й год;
- 2) равномерные траты;
- 3) все траты в последний год.

Стратегия	Год								Суммарные приведенные затраты
	1	2	3	4	5	6	7	8	
1	8	–	–	–	–	–	–	–	8.0
2	1	1	1	1	1	1	1	1	5.9
3	–	–	–	–	–	–	–	8	4.2

Постановка задачи

g — начальная стоимость оборудования;

c_t — стоимость эксплуатации оборудования в t год, $c_{t+1} \geq c_t$;

Система функционирует бесконечно, оборудование периодически заменяется.

T — период замены оборудования;

S_T — суммарные затраты при фиксированном периоде замены T :

$$S_T = g + \sum_{t=1}^T \alpha^{t-1} c_t + \alpha^T g + \sum_{t=1}^T \alpha^{T+t-1} c_t + \alpha^{2T} g + \sum_{t=1}^T \alpha^{2T+t-1} c_t + \dots$$

за первые T лет за вторые T лет

Благодаря дисконтированию затрат ($\alpha < 1$) величина S_T конечна:

$$S_T = (g + \sum_{t=1}^T \alpha^{t-1} c_t)(1 + \alpha^T + \alpha^{2T} + \dots) = (g + \sum_{t=1}^T \alpha^{t-1} c_t) / (1 - \alpha^T) < \infty.$$

Задача отыскания оптимального периода замены оборудования: $S_T \rightarrow \min_{T>0}$

Применение динамического программирования

Рассмотрим систему, функционирующую в течение T лет, причем решение о замене оборудования принимается каждый год.

Дано: $\{1, \dots, m\}$ — набор типов оборудования;

g_t^i — стоимость оборудования i -го типа, купленного в год t ;

$c_t^i(\tau)$ — стоимость годовых эксплуатационных затрат на оборудование i -го типа, купленного в год t и проработавшего τ лет;

$\Phi_t^i(\tau)$ — остаточная стоимость оборудования i -го типа возраста τ , купленного в год t ;

n — максимально допустимый возраст оборудования;

i_0, τ_0 — тип и возраст оборудования в начале функционирования;

Пусть $S_t^i(\tau)$ — минимальные суммарные затраты в интервале $[t, T]$, приведенные к началу t -го года, при условии, что в начале t -го года было оборудование типа i возраста τ . Требуется найти $S_1^{i_0}(\tau_0)$.

Рекуррентные соотношения:

$$S_T^i(\tau) = \min \begin{cases} c_{T-\tau}^i(\tau+1) - \alpha \Phi_{T-\tau}^i(\tau+1), & \text{если замены нет,} \\ \min_{1 \leq k \leq m} [g_T^k + c_T^k(1) - \alpha \Phi_T^k(1)] - \Phi_{T-\tau}^i(\tau), & \text{в случае замены,} \end{cases}$$

$$1 \leq \tau \leq n, \quad 1 \leq i \leq m,$$

$$S_t^i(\tau) = \min \begin{cases} c_{t-\tau}^i(\tau+1) + \alpha S_{t+1}^i(\tau+1), & \text{если продолжаем эксплуа-} \\ & \text{тировать оборудование} \\ \min_{1 \leq k \leq m} [g_t^k + c_t^k(1) + \alpha S_{t+1}^k(1)] - \Phi_{t-\tau}^i(\tau), & \text{если заменяем оборудование} \end{cases}$$

$$1 \leq \tau \leq n, \quad 1 \leq i \leq m, \quad 1 \leq t < T.$$

Алгоритм может быть реализован с трудоемкостью $T = O(m^2 n T)$, и памятью $\Pi = O(mnT)$.

Вопросы

- ε -аппроксимационная схема является полностью полиномиальной, если ее трудоемкость полиномиально зависит от ε и от длины записи исходных данных (*Да или Нет*)?
- Для задачи замены оборудования метод динамического программирования дает точное решение с полиномиальной трудоемкостью (*Да или Нет*)?
- Для задачи замены оборудования метод динамического программирования можно обобщить на случай, когда коэффициент дисконтирования зависит от времени (*Да или Нет*)?
- Для задачи замены оборудования метод динамического программирования можно вести не с конца планового периода, а с начала (*Да или Нет*)?
- В чем недостатки модели замены оборудования?