



بهینه سازی مقدمات

محسن هوشمند
دانشکده تکنولوژی اطلاعات و علم رایانه
دانشگاه تحصیلات تکمیلی علوم پایه زنجان

ارزیابی

Digital filters [7]–[10]: sophisticated filter banks [7] were designed to recognize QRS complexes in which they analyzed the positions and magnitudes of sharp waves and used a special digital band-pass filter to reduce the false detection of ECG signals in the MIT-BIH database [11]. The difference operation method (DOM) [8] scheme including two stages was proposed: the first stage was to find the point R by applying the difference equation operation to an ECG signal, then the second stage looked for the points Q and S based on the point R to find the QRS complex. The work [9] used some special digital filters to detect and classify ECG signal in time or frequency domain. Slope- and peak-sensitive band-pass filters were employed for the detection [10]. The morphological smoothing further improved its performance.

Wavelet transform (WT) [12]–[16]: the transform yields a time-scale representation similar to the time-frequency representation of the short-time Fourier transform (STFT) [12], while the WT uses a set of analyzing functions that allows a variable time and frequency resolution for different frequency bands [13]. By the multiscale feature of WT, the QRS complex can be distinguished from high P or T waves, noise, and baseline drift. The dyadic discrete WT (DWT) was usually implemented using a dyadic filter bank where the filter coefficients were directly derived from the wavelet function [14]. The WT based on the adaptive threshold [15] and WT based on multi-lead ECG [16] were evaluated on the QT database [17].

Adaptive matched filters [18]–[22]: a two-stage successive cancellation algorithm that sequentially separates

تمرین‌ها

▪ کتبی

▪ عملی

تحقیق و پیاده‌سازی

امتحان

▪ خلق دانش

▪ کپی‌پیست (گرفتن گذاشتن) اعلام منابع هر تمرین

مراجع و منابع

[فلچر] R. Fletcher, "Practical Methods of Optimization," 2nd Ed, 2000.

[نازه دل] J. Nocedal, S. Wright, "Numerical Optimization," Springer, 2nd ed., 2006.

[آنتونیو] A. Antoniou, W. Lu "Practical Optimization- Algorithms and Engineering Applications," Springer, 2007.

[لوئنبرگر] D. Luenberger, Y. Ye, "Linear and Nonlinear Programming," Springer, 4th ed., 2016.

منابع کمکی

[دایزن روٹ] M. Deisenroth, A. Faisal, C. Ong, "Mathematics for Machine Learning," Cambridge University Press, 2019.

[چاپرا] S. Chapra, R. Canale, "Numerical Methods for Engineers," McGraw Hill, 6th ed., 2009.

[جهان شاهلو]

[دانتریگ]

اینترنت و مقالات

[فرهنگستان] واژه‌های مصوب فرهنگستان، دسترسی از طریق مانه

[انوری] ح. انوری و دیگران، «فرهنگ بزرگ سخن»، انتشارات سخن، ۱۳۹۲

[رانکوهی] م.ت. روحانی رانکوهی، «فرهنگ داده»، انتشارات جلوه،

اعلانات

فلچر ۱۹۸۷

- میدان بهینه‌سازی به مثابه
- «ترکیب سحرانگیز نظر و رایانش، مکاشفه و دقت»

اعلانات

حل تمرین:

نحوه ارسال تمرین‌ها، پروژه‌ها، دیگر موارد

▪ ا-نامه behinesazi.iasbs@gmail.com

▪ عنوان: «بهبینه‌سازی-تمرین سری اول»

▪ فایل متنی: قالب پی‌دی‌اف

▪ نام فایل: [B-T#-Afshar-Mahmoud_Sotode-Morteza.pdf](#)

▪ نام فایل: [B-P#-Afshar-Mahmoud_Sotode-Morteza.pdf](#)

▪ دیگر فایل‌ها

▪ نام فایل: [B-T#-Afshar-Mahmoud_Sotode-Morteza.zip](#)

تمرین بهینه‌سازی با نوشتن کد

فهم الگوریتم

پیچیدگی

حافظه لازم

درخشانی

توانایی بالای برنامه‌نویسی لازم نیست

▪ ولی میزان محاسباتی لازم است.

▪ متلب یا پیتون

بهینه‌سازی در عمل

الگوریتم قوی و کارا

مدل‌سازی مناسب

تفسیر دقیق نتایج

برنامه کاربرپسند

مطالبی که عرضه خواهد شد

مقدمه

مقدمه ریاضی

▪ جبر خطی

▪ حسابان

روش‌های بهینه‌سازی نامقید

روش‌های بهینه‌سازی خطی

روش‌های بهینه‌سازی مقید

روش‌های مکاشفه‌ای

▪ یا در قالب تدریس یا در قالب ارائه مقاله درسی

بهینه سازی

فرایند یافتن «بهترین»

- بیشترین یا بیشینه دخل
- کمترین یا کمینه خرج

بهینه

- به معنای «بیشینه» یا «کمینه»
- اصطلاحی فنی
- اندازه گیری کمی

بهینه سازی

بشر بهینه عمل می کند

- سرمایه گذاران
- سازندگان
- مهندسان

طبیعت بهینه عمل می کند

- سیستم های فیزیکی
- مولکول ها
- اشعه نوری

مهم در تصمیم و تحلیل

حل مسائل بهینه‌سازی

استفاده فراوان در علم و مهندسی و اقتصاد و صنعت

مقاطع مورد استفاده

- مدل‌سازی، تعیین مشخصات، و طراحی ابزارها و مدارها و سیستم‌ها
- طراحی ساختارها و ساختمان‌ها
- کنترل فرایند
- نظریه تخمین، برازش منحنی، حل دستگاه معادلات
- پیش‌بینی، زمان‌بندی تولید، کنترل کیفیت
- نگهداری و تعمیر
- شبکه‌های عصبی و سیستم‌های تطبیقی
- بازارهای مالی

یادگیری توانائی‌ها و محدودیت‌ها منجر به

- فهم بهتر تاثیر آن در حوزه‌های مختلف

ریشه در حساب تغییرات

اویلر و لاگرانژ

معمولا معروف به برنامه‌ریزی ریاضیاتی
▪ دهه بیست شمسی توسعه برنامه‌ریزی خطی

بهینه‌سازی

مسائل واقعی

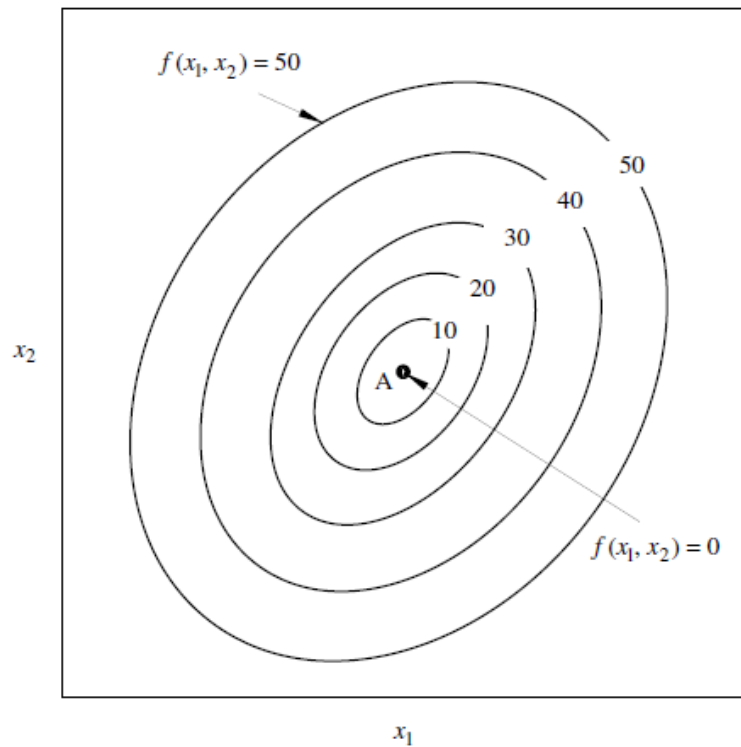
- دارای انواع حل‌ها
- معمولا تعداد بی‌نهایت پاسخ
- بهینه‌سازی با یافتن بهترین پاسخ
- در صورت تک پاسخی بودن
- بهینه‌سازی بی‌معنی

بهینه‌سازی - انواع حل

روش‌های کلی

- روش‌های تحلیلی
- روش‌های گرافیکی
- روش‌های آزمایشی
- روش‌های عددی

بهینه‌سازی - انواع



روش‌های کلی

روش‌های تحلیلی

- مبتنی بر حسابان
- ابتدا توضیح ریاضی مسئله
- عدم نیاز به رایانه
- سخت جهت اعمال بر مسائل سخت غیرخطی و یا متغیرهای فراوان

روش‌های گرافیکی

- رسم تابع
- چند متغیر؟!
- رسم تابع بر اساس تک متغیر مستقل
- ترازبندی: مجموعه نقاط (x_1, x_2) با $f(x_1, x_2)$ برابر
- ناکارآمد یا غیرممکن برای تعداد متغیرهای بیشتر

بهینه‌سازی - انواع

▪ روش‌های آزمایشی

- آزمایش تک به تک متغیرها
- امکان رسیدن به بهینه یا نزدیک-بهینه
- امکان رسیدن به جواب‌های نامطمئن
- چرا؟
- تعامل چند متغیر با یکدیگر و نیاز به آزمایش همزمان آنها

▪ روش‌های عددی

- مهم‌ترین روش عمومی
- استفاده از رویه‌های مرحله به مرحله (تکراری)
- شروع از حدسی اولیه
- پایان با رسیدن به ملاک همگرایی
- مثال؟
- مورد استفاده جهت حل مسائل پیچیده
- حل ناپذیر تحلیلی
- برنامه‌پذیری رایانه‌ای راحت
- روش‌های غالب

بهینه‌سازی - انواع

برنامه‌ریزی ریاضیاتی

▪ پارادایم حاکم بر نظر و عمل روش‌های بهینه‌سازی عددی

شامل

▪ برنامه‌ریزی خطی

▪ برنامه‌ریزی عدد صحیح

▪ برنامه‌ریزی غیرخطی

▪ برنامه‌ریزی پویا

بهینه‌سازی - مختصر

جهت استفاده

- نیاز به مشخص کردن مقصود (هدف)
- «اندازه‌گیری کمی کارکرد سیستم تحت مطالعه»
- مثال
 - سود
 - زیان
 - انرژی پتانسیل
- نگاشت به عددی
 - نمایشگر یک کمیت یا ترکیبی از چند کمیت
- هدف وابسته به مشخصه‌های خاص از سیستم
 - متغیرها، مجهول‌ها
- مقصود
 - یافتن مقادیر بهینه‌ساز هدف

بهینه‌سازی - مختصر - ادامه

مقصود

- یافتن مقادیر متغیرها جهت بهینه‌سازی هدف

معمولا دارای حد و حدود

▪ مثال

- مقادیر نامنفی چگالی الکترون در مولکول

- میزان بهره

بهبودسازی - مدل سازی

فرایند مشخص کردن هدف، متغیرها، محدودیت‌های مسئله معرفی شده

قدم اول

- ایجاد مدل مناسب

نمایش ساده شده چیزی حقیقی

- چرا؟

انگیزه‌های مختلف

- کمتر کردن پیچیدگی

- فهم مسئله

- یافتن راحت‌تر حل

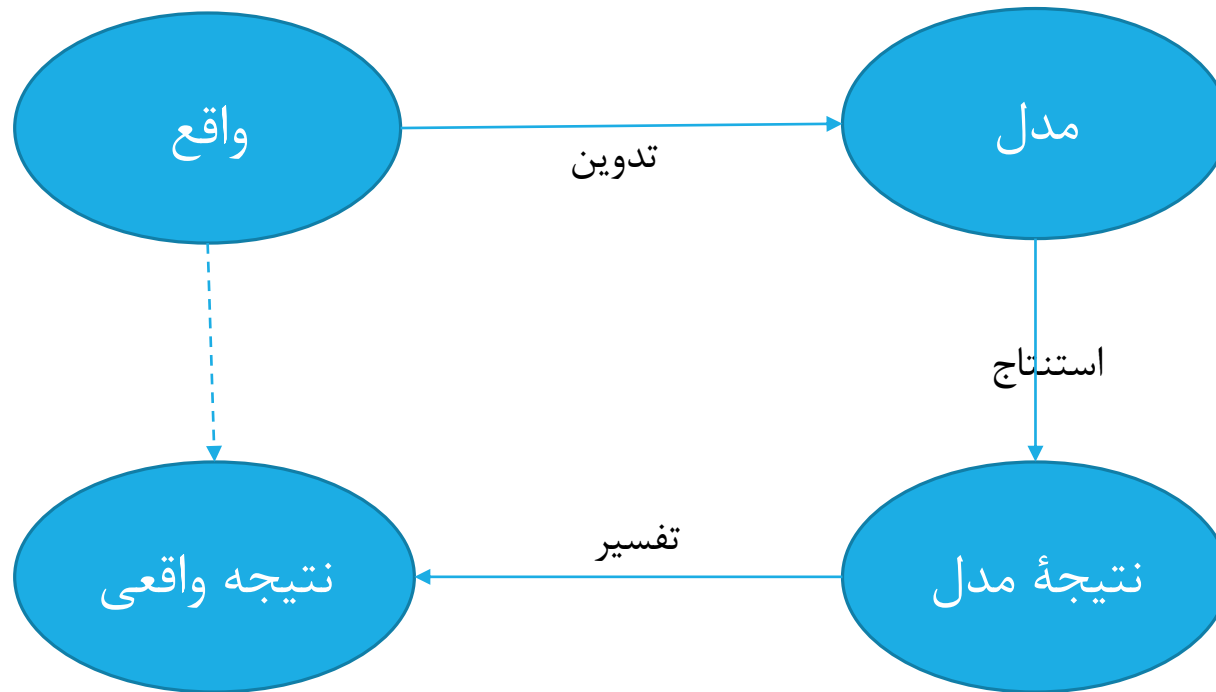
ساده‌انگاری

- عدم نمایش درست مسئله

زیادی سخت

- حل مشکل اگر نه غیرممکن

مدل‌بندی - ادامه



مدل بندی - ادامه

مسئله در محیط واقع

تدوین مدل

- چه جنبه‌هایی در نظر گرفته می‌شود
- چه جنبه‌هایی نادیده گرفته می‌شود
- مفروضات
- نوع مدل

استنتاج

- حل معادلات
- الگوریتم
- منطق

تفسیر

- ترجمه به محیط واقع

بهبینه سازی - الگوریتم بهینه سازی

جهت یافتن راه حل

معمولا با رایانه

الگوریتم واحد و جامع؟

▪ خیر

▪ قضیه «نبود ناهار مفت»

مجموعه الگوریتم‌ها

سعی بر انطباق الگوریتم با مسئله خاص

انتخاب الگوریتم درست و وظیفه کاربر

تاثیر بر سرعت راه حل

▪ حتی بر یافتن راه حل

بهینه‌سازی - شرایط بهینگی

پس از اعمال الگوریتم روی مدل

نیاز به بررسی یافتن درست راه‌حل

وارسی مجموعه مقادیر یافت‌شده متغیرها

اطلاع مفید درباره تخمین فعلی

تحلیل حساسیت

- حساسیت پاسخ به تغییرات در مدل و داده
- با تغییر مدل نیاز به تکرار حل مسئله

تدوین ریاضی

کمینه‌سازی یا بیشینه‌سازی تابع با در نظر گرفتن قیدهایی روی متغیرهای تابع \mathbf{x} بردار متغیرها (یا مجهول‌ها، پارامترها)

f تابع هدف، تابعی (عددی) از \mathbf{x} که قصد بیشینه یا کمینه کردن آن را داریم

c_i توابع نمایشگر قیدهایی شامل تساوی‌ها و نامساوی‌ها که مقادیر \mathbf{x} پاسخ تابع f باید آن‌ها را رعایت کنند

$$\min_{\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n} f(\mathbf{x})$$

با توجه

$$c_i(\mathbf{x}) = 0 \quad i \in \mathcal{E}$$

$$c_i(\mathbf{x}) \geq 0 \quad i \in \mathcal{I}$$

\mathcal{E} و \mathcal{I} مجموعه اندیس‌های قیدهای تساوی و نامساوی

مثال

با

$$\min ((x_1 - 2)^2 + (x_2 - 1)^2)$$

به طوریکه

$$x_1^2 - x_2 \leq 0$$

$$x_1 + x_2 \leq 2$$

مثال

$$\min ((x_1 - 2)^2 + (x_2 - 1)^2)$$

به طوریکه

$$x_1^2 - x_2 \leq 0$$

$$x_1 + x_2 \leq 2$$

بازنویسی شبیه تدوین معرفی شده

$$f(x) = (x_1 - 2)^2 + (x_2 - 1)^2, \quad x = \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix},$$

$$c(x) = \begin{bmatrix} c_1(x) \\ c_2(x) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -x_1^2 + x_2 \\ -x_1 - x_2 + 2 \end{bmatrix}, \quad \mathcal{I} = \{1, 2\}, \quad \mathcal{E} = \emptyset.$$

مثال - ادامه

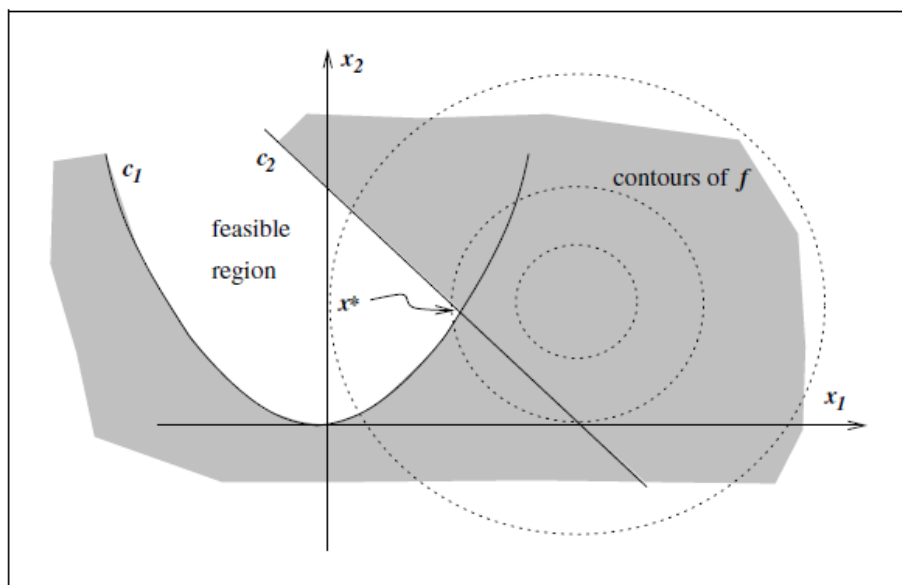
ترازهای تابع هدف

▪ مجموعه نقاطی که $f(x)$ دارای مقدار ثابت

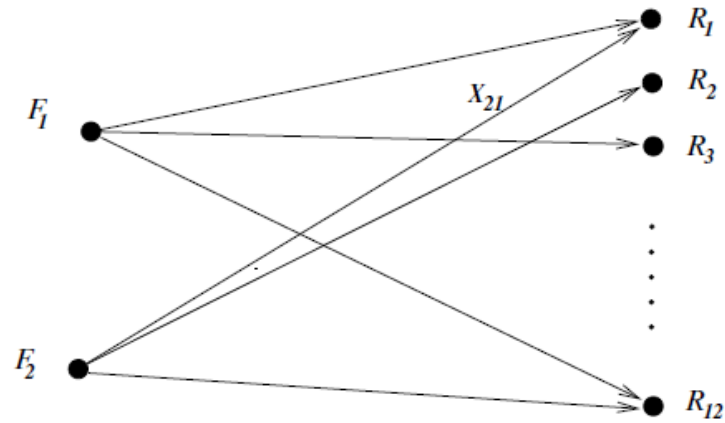
منطقه شدنی (امکان پذیر)

▪ مجموعه نقاطی که تمامی قیدها را رعایت می کند.

x^* حل مسئله



مثال ۲ - مسئله ترابری



شرکتی

▪ دو کارخانه F_1 و F_2

▪ دوازده نمایندگی فروش (خرده‌فروشی) R_1 تا R_{12}

▪ F_i عرضه a_i تن از محصول در هر هفته

▪ ظرفیت

▪ R_j تقاضای b_j تن از محصول در هر هفته

▪ c_{ij} هزینه ارسال از F_i به R_j

مسئله: یافتن مقادیر انتقال محصول بین کارخانه‌ها و فروشگاه‌ها جهت برآورده‌سازی نیازها و کمینه‌سازی هزینه‌ها

مثال ۲ - مسئله ترابری - ادامه

تدوین

$$\min \sum_i \sum_j c_{ij} x_{ij}$$

به طوری که

$$\sum_{j=1}^{12} x_{ij} \leq a_i, \quad i = 1, 2$$

$$\sum_{i=1}^2 x_{ij} \geq b_j, \quad j = 1, \dots, 12$$

$$x_{ij} \geq 0, \quad i = 1, 2, j = 1, \dots, 12$$

بهینه‌سازی - پیوسته در مقابل گسسته

متغیرها مقادیر صحیح

- تعداد نیروگاه در پنج سال آینده
- نیاز یا عدم‌نیاز به کارخانه‌ای خاص در شهری خاص

برنامه‌ریزی عدد صحیح

- بهینه‌سازی گسسته
- یکی از مهم‌ترین جلوه‌های ناکوژی

گاهی اوقات ترکیب اعداد صحیح و اعداد حقیقی

- برنامه‌ریزی عدد صحیح آمیخته (بصا)

بهینه‌سازی پیوسته

- نامتناهی ناشمارا
- حل ساده‌تر
- همواری تابع موجب تصمیم‌گیری ساده‌تر حول نقطه x

بهبینه‌سازی - مقید و نامقید

انواع تقسیم‌بندی‌ها

- طبیعت تابع هدف و قیدها (خطی، غیرخطی، کوژ)
- تعداد متغیرها (کم، زیاد)
- همواری تابع (مشتق‌پذیر یا مشتق‌ناپذیر)

دارای قید محدودیت و بدون محدودیت

بهبینه‌سازی نامقید $E = I = 0$
▪ امکان تبدیل مسائل مقید به نامقید

بهبینه‌سازی مقید

- محدودیت بودجه در اقتصاد
- محدودیت شکل در طراحی
- در اشکال مختلف
 - حد بالا و پائین
 - محدودیت خطی
 - نامساوی‌های غیرخطی

برنامه‌ریزی خطی

- تابع و قیدها توابع خطی
- پرمطلب‌ترین

برنامه‌ریزی غیرخطی

- حداقل یک یا چند قید یا هدف تابع غیرخطی

بهینه‌سازی - محلی و سراسری

بیشتر به دنبال راه‌حلی محلی

- نقطه‌ای با کوچکترین مقدار تابع هدف از میان نقاط امکان‌پذیر همسایه

- به دنبال راه‌حل سراسری نیست

- نقطه با کمترین مقدار تابع در میان تمامی نقاط امکان‌پذیر

- نیاز به راه‌حل سراسری در بعضی مسائل

- سختی یافتن و مشخص کردن

- برنامه‌ریزی کوژ

- برنامه‌ریزی خطی

- جواب‌های محلی همان جواب‌های سراسری

- مسائل غیرخطی

- پاسخ محلی لزوماً راه‌حل سراسری نیست

بهینه‌سازی - معین و تصادفی

مشخص نبودن کامل مدل در بعضی مسائل

وابستگی به مقادیری نامعلوم در زمان تدوین

- مدل طرح‌های مالی و اقتصادی وابسته به آینده میزان بهره، تقاضای محصول در آینده، قیمت کالای خام در آینده
- عدم قطعیت طبیعی بسیاری از سیستم‌ها

بهتر از «بهترین حدس»

- دستیابی به راه‌حل‌های مفیدتر مدل‌ها با مشارکت دانش افزوده‌ای
- نوشتن چند سناریو و تخمین احتمال هر سناریو
- استفاده بهینه‌سازی تصادفی جهت تخمین «امید» کارکرد مدل

موارد مرتبط

- بهینه‌سازی مقید-شانس: متغیر قیدی را با مقدار مشخصی از احتمال برآورده کند
- بهینه‌سازی استوار: بعضی از قیود باید کاملاً رعایت شوند

مجموعه کوز

مجموعه کوز

$S \in \mathbb{R}^n$ ▪

▪ «قطعه» خطی مستقیم واصل دو نقطه از S

▪ کل قطعه خط در S خواهد بود

$$x_1, x_2 \in S \xrightarrow{\forall \theta \in [0,1]} x_\theta = \theta x_1 + (1 - \theta)x_2 \in S$$

مجموعه کوژ

مجموعه کوژ

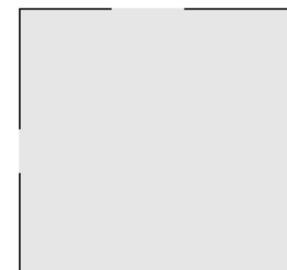
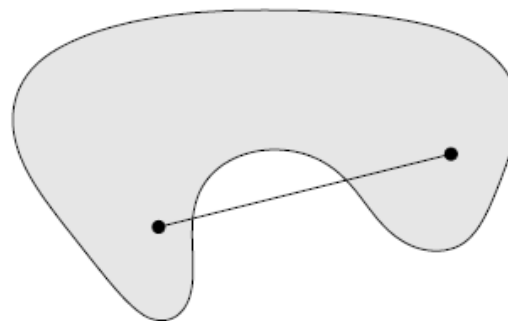
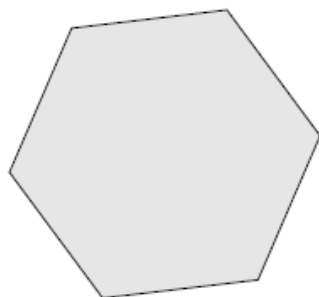
$$S \in \mathbb{R}^n$$

▪ «قطعه» خطی مستقیم واصل دو نقطه از S

▪ کل قطعه خط در S خواهد بود

$$x_1, x_2 \in S \xrightarrow{\forall \theta \in [0,1]} x_\theta = \theta x_1 + (1 - \theta)x_2 \in S$$

چند نمونه کوژ و ناکوژ



مجموعه کوژ

مجموعه تهی

تک نقطه

تمامی فضای \mathbb{R}^n

خط یا تکه خط

ابرفحه (معادله خطی) $\mathbf{a}^T \mathbf{x} = b$

نیم‌فضا (نامساوی خطی) $\mathbf{a}^T \mathbf{x} \geq b$

کره $\|\mathbf{x} - \mathbf{x}'\| \leq h$

مخروط کوژ

مثال- پاسخ‌های دستگاه معادلات خطی

$$C = \{\mathbf{x} | A\mathbf{x} = \mathbf{b}\},$$

$$A \in R^{m \times n}, \mathbf{b} \in R^m$$

$$\mathbf{x}_1, \mathbf{x}_2 \in C \implies A\mathbf{x}_1 = \mathbf{b}, A\mathbf{x}_2 = \mathbf{b}$$

$$A(\theta\mathbf{x}_1 + (1 - \theta)\mathbf{x}_2) = \theta A\mathbf{x}_1 + (1 - \theta)A\mathbf{x}_2$$

$$= \theta\mathbf{b} + (1 - \theta)\mathbf{b}$$

$$= \mathbf{b}$$

$$\implies \theta\mathbf{x}_1 + (1 - \theta)\mathbf{x}_2 \in C$$

مجموعه کوژ-ادامه

تعمیم تعریف مجموعه کوژ

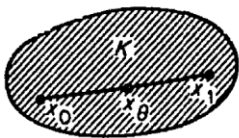
$$\forall x_i \in S, i = 1, \dots, m \Rightarrow x_\theta \in S, x_\theta = \sum_{i=1}^m \theta_i x_i, \sum_{i=1}^m \theta_i = 1, \theta_i \geq 0$$

x_θ ترکیب کوژ نقاط x_1 و x_2 و ...

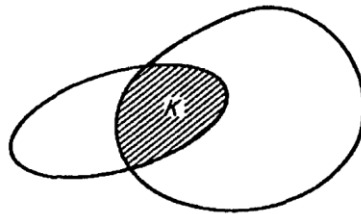
پوسته کوژ

▪ x_m و ... و x_2 و x_1

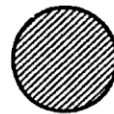
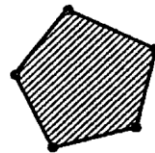
▪ تمامی نقاط x_θ مندرج در مجموعه بالا



Convex combination



Intersection

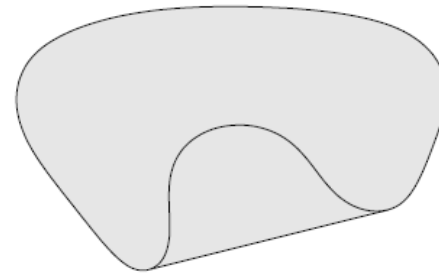
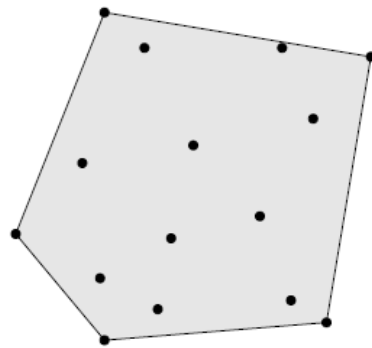


Extreme points

پوسته کوز

مجموعه ترکیب کوز تمامی نقاط مجموعه
 $\mathfrak{M} \in \mathbb{R}^n$.

$$\text{Koz}\mathfrak{M} = \{\theta_1 x_1 + \theta_2 x_2 + \dots + \theta_m x_m \mid x_1, x_2, \dots, x_m \in \mathfrak{M}, \theta_i \geq 0, \forall i = 1, \dots, m, \theta_1 + \theta_2 + \dots + \theta_m = 1\}$$



تابع کوژ

تابع کوژ

▪ دامنه S کوژ و

$$x_1, x_2 \in S \Rightarrow f(\theta x_1 + (1 - \theta)x_2) \leq \theta f(x_1) + (1 - \theta)f(x_2), \quad \forall \theta \in [0, 1]$$

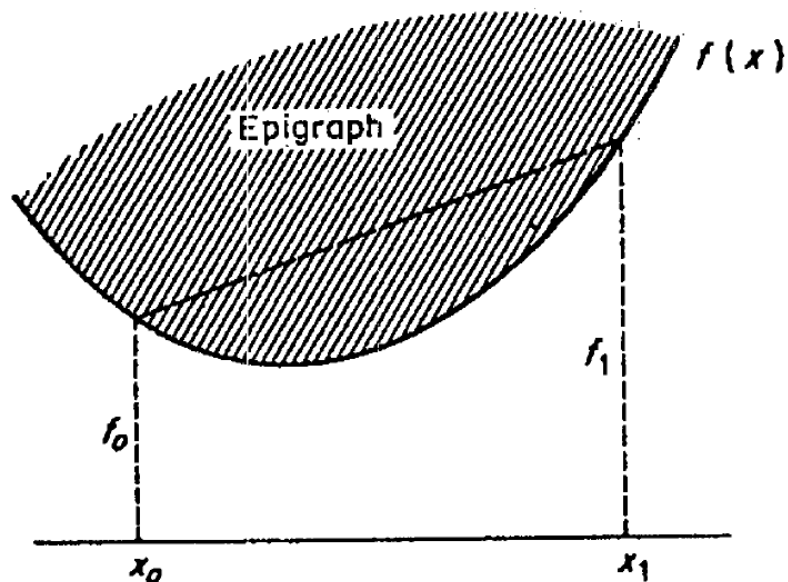
▪ مثال -

▪ توپ کوژ $\{\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n \mid \|\mathbf{x}\|_2 \leq 1\}$

▪ چندضلعی‌های تعریفی با مساوی‌ها و نامساوی‌های خطی $\{\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n \mid A\mathbf{x} = b, C\mathbf{x} \leq d\}$

▪ تابع درجه دو کوژ $f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T H \mathbf{x}$

▪ تابع اکیدا کوژ: نامساوی اکیدا با شرط $\theta \in (0, 1), x_1 \neq x_2$



Graph below chord

برنامه ریزی کوژ

کوژ بودن تابع هدف

خطی بودن قیدهای مساوی

کاو بودن قیدهای نامساوی

الگوریتم‌های بهینه‌سازی

تکراری

▪ مرحله به مرحله

آغاز با حدس اولیه متغیرهای x

تولید دنباله‌ای از تخمین‌های بهتر

ادامه تا زمان ختم الگوریتم

تمایز الگوریتم‌ها از یکدیگر

▪ استراتژی حرکت از قدم فعلی به قدم بعدی

▪ اکثراً استفاده از اطلاعات تابع هدف، قیود، [مشتق اول توابع مذکور]، [مشتق دوم توابع مذکور]

الگوریتم‌های بهینه‌سازی - ادامه

انتخاب الگوریتم و همگرایی و سرعت همگرایی

ویژگی‌های الگوریتم مناسب

- استواری
- اجرای مناسب روی گستره وسیعی از مسائل
- کارایی
- عدم نیاز به زمان یا حافظه زیاد جهت محاسبات
- صحت
- یافتن پاسخ با دقت بالا
- بدون حساسیت فراوان به خطا در داده یا گرد کردن

ناسازگاری اهداف

- همگرایی سریع پاسخ مسئله غیرخطی نیاز به حافظه زیاد
- روش استوار، کند
- سبک‌سنگین کردن نقشی اساسی در طراحی

عدم توجه به

بهینه‌سازی شبکه

برنامه‌ریزی عدد صحیح

برنامه‌ریزی تصادفی

برنامه‌ریزی ناهموار

بهینه‌سازی سراسری

تدوین ریاضی

$$\min_{x \in \mathbb{R}^n} f(x)$$

با توجه

$$c_i(x) = 0 \quad i \in \mathcal{E}$$

$$c_i(x) \geq 0 \quad i \in \mathcal{I}$$

\mathcal{E} و \mathcal{I} مجموعه اندیس‌های قیدهای تساوی و نامساوی

بهینه‌سازی - انواع

$c(x)$	$f(x)$	نام
-	غیر خطی	بهینه‌سازی نامقید
خطی	خطی	برنامه‌ریزی خطی
خطی	درجه دو	برنامه‌ریزی درجه دو
خطی	غیر خطی	بهینه‌سازی مقید خطی
غیر خطی	غیر خطی	بهینه‌سازی مقید یا بهینه‌سازی غیر خطی

منابع

[نازه دل]

[آنتونیو]

[جهان شاه لو]

[فلچر]

[بوید]