#### Лекция

Эволюционные алгоритмы. Генетические алгоритмы.

## Эволюционные алгоритмы

- Эволюционные алгоритмы основаны на принципе «выживает наиболее приспособленный». Базовые принципы:
  - «Популяция», состоящая из большого количества потенциальных решений.
  - Случайные изменения в решениях.
  - Отбор решений в следующее поколение на основе приспособленности. Приспособленность отражает качество решения.
  - T.e. ЭА вариант случайного поиска, но вместо одного текущего решения популяция.

- •Достоинства ЭА
  - Универсальный механизм для решения большого класса оптимизационных задач
  - Применимы для слабо формализованных задач
  - Применимы для задач с большим пространством решений
  - Достаточно легко распараллеливаются Недостатки ЭА
  - Нет гарантий качества результата
  - Универсальность => не учитываются особенности конкретной задачи
  - Обычно требуют значительных вычислительных затрат.

## Генетические алгоритмы

• Наиболее известная и широко используемая разновидность эволюционных вычислений.

Отличительные особенности:

- Потенциальное решение представляется в виде цепочки символов (обычно бинарных, но возможен и произвольный алфавит) «хромосома» или «особь». Отдельные символы называются генами.
- Для получения следующей популяции к текущей популяции применяются *генетические операторы*: мутация, скрещивание, отбор. Т.е. кроме чисто вероятностных преобразований (мутаций)

используются скрещивания - преобразования, «сохраняющие» и «усиливающие» удачные фрагменты решений.

- Генетические алгоритмы возникли в результате наблюдения и попыток копирования естественных процессов, происходящих в мире живых организмов, в частности, эволюции и связанной с ней селекции (естественного отбора) популяций живых существ. Идею генетических алгоритмов (genetic algorithm GA) высказал Джон Холланд в конце 60-х годов ХХ века. Холланд был уверен в возможности составить и реализовать в виде компьютерной программы алгоритм, который будет решать сложные задачи так, как это делает природа путём эволюции.
- Эти алгоритмы имитировали эволюционные процессы в **поколениях таких хромосом**. В них были реализованы механизмы **селекции** и **репродукции**, аналогичные существующим в природе. Для отражения **приспособленности хромосомы** требовалась некоторая оценка.

**Механизм селекции** заключается в выборе хромосом с **наивысшей оценкой** (наиболее приспособленных), которые репродуцируют чаще, чем особи с более низкой оценкой (хуже приспособленные).

- Репродукция означает создание новых хромосом в результате рекомбинации генов родительских хромосом. Рекомбинация это процесс, в результате которого возникают новые комбинации генов. Для этого используются две операции: скрещивание, позволяющее создать две совершенно новые хромосомы потомков путём комбинирования генетического материала пары родитилей, мутация, которая может вызывать изменения в отдельных хромосомах.
- *Мутация* случайное изменение одной или нескольких позиций в хромосоме. Например, 1010011 -→ 1010001.

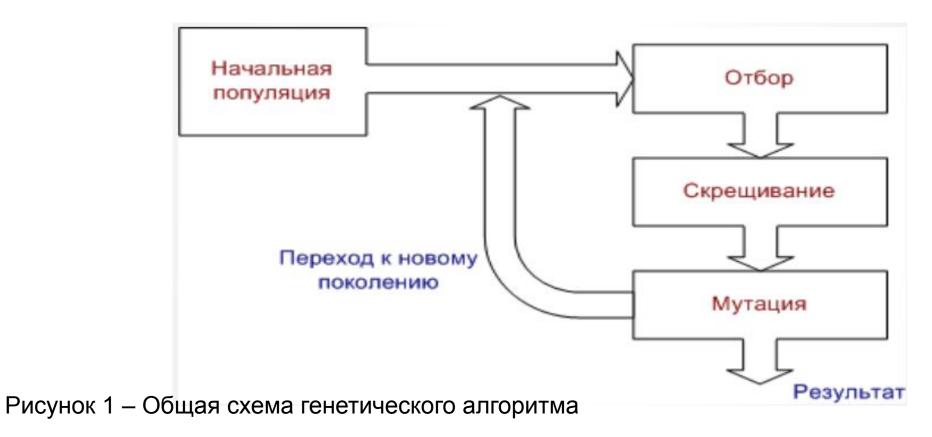
Разновидностью скрещивания является Кроссинговер (кроссовер) — операция, при которой две хромосомы обмениваются своими частями. Например,

 $1100\&1010 \longrightarrow 1110\&1000.$ 

В ГА применяется ряд терминов, заимствованных из генетики, прежде всего: гены и хромосомы, а также популяция, особь, аллель, генотип, фенотип.

#### Ключевые параметры конкретного ГА:

- Представление потенциальных решений
- Оценка приспособленности (стоимость решения, для максимизации)
- Операция мутации
- Операция скрещивания
- Операция отбора (селекции)



### Основные понятия

• Популяция — конечное множество особей. Особи, входящие в популяцию, представляются хромосомами с закодированными в них параметрами задачи, т.е. решениями, которые иначе называются точками в пространстве поиска. В некоторых работах особи называются организмами. Хромосомы (цепочки или кодовые последовательности) — это упорядоченные последовательности генов. Ген (свойство, знак или детектор) — атомарный элемент генотипа, в частности, хромосомы.

• **Генотип** или **структура** — это **набор хромосом** данной особи.

Следовательно, особями популяции могут быть генотипы либо единичные хромосомы (распространённый случай: генотип состоит из одной хромосомы).

Фенотип — это набор значений, соответствующих данному генотипу, т.е. декодированная структура или множество параметров задачи (решение, точка пространства поиска). Аллель — совокупность подряд идущих генов Локус или позиция — позиция гена в хромосоме (цепочке). Множество позиций генов — это локи.

- Очень важным понятием в теории ГА является функция приспособленности (fitness function), иначе называемой функцией оценки. Она представляет меру приспособленности данной особи в популяции.
- В задачах оптимизации подобная функция называется целевой функцией и максимизируется или минимизируется в зависимости от условий задачи.
- При помощи функции приспособленности оценивается приспособленность каждойособи данной пупуляции на каждой итерации ГА, на основе чего создаётся следующая популяция особей, составляющих множество потенциальных решений проблемы, например, задачи оптимизации.
- Очередная популяция в ГА называется **поколением**, а к вновь создаваемой популяции особей применяется термин «новое поколение» или «поколение потомков».

## Пример представления популяций:

Рассмотрим функцию

• 
$$f(x)=2x^2+1$$

и допустим, что принимает значения из интервала от 0 до 15. Задача оптимизации этой функции заключается в перемещении по пространству, состоящему из 16 точек со значениями 0, 1, ..., 15 для обнаружения той точки, в которой функция принимает максимальное или минимальное значение.

В качестве параметра задачи выступает переменная.

Множество {0,1,...,16} составляет **пространство поиска** и одновременно — множество потенциальных решений задачи.

Каждое из 16 чисел из этого множества называется точкой пространства поиска, решением, значением параметра, фенотипом. Решение, оптимизирующее функцию, называется наилучшим или оптимальным решением.

- Значения параметра х можно закодировать следующим образом: 0000 0001 0010 0011 0101 0110 0111 1000 1001 1011 1100 1101 1110 1111 Эти последовательности также называются **цепями** или **хромосомами**. В данном примере они выступают в роли **генотипов**. Каждая из хромосом состоит из 4 генов.
- Значение гена в конкретной позиции называется **аллелью**, принимающей в данном случае значения 0 или 1. **Популяция** состоит из особей, выбираемых среди указанных 16 хромосом.

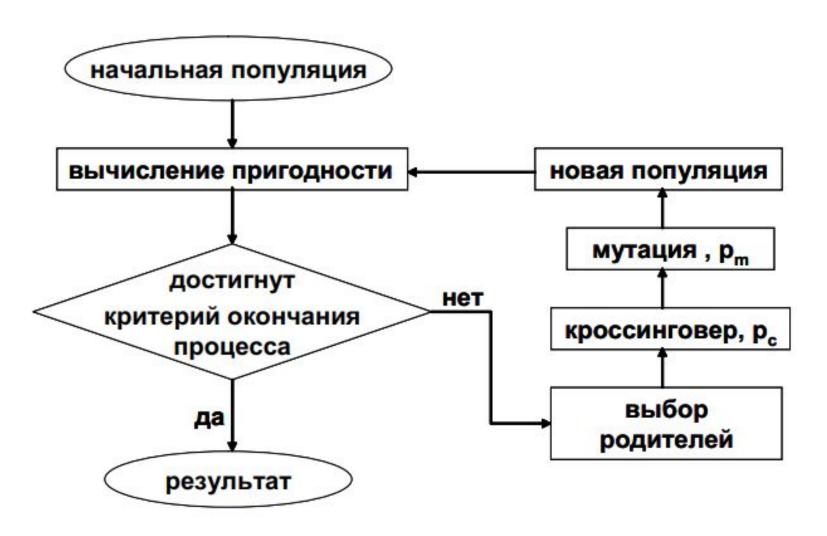
Примером популяции с численностью, равной 6 может быть, например, множество хромосом [0010, 0101, 0111, 1001, 1100, 1110], представляющих собой закодированную форму следующих фенотипов: [2, 5, 7, 9, 12, 14]

• **Функция приспособленности** Fitness в этом примере задаётся выражением:

$$f(x)=2x^2+1$$
.

Приспособленность отдельных хромосом в популяции определяется значением этой функции для значений, соответствующих этим хромосомам, т.е. для фенотипов, соответствующих определённым генотипам.

## Схема простого ГА



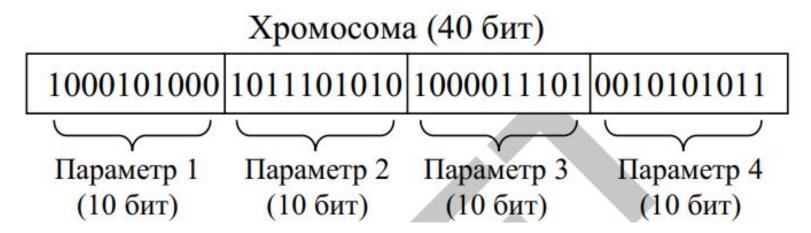
## Основные принципы работы ГА

- Основные принципы работы ГА заключены в следующей схеме (см. рис. 2):
  - 1. Генерируем начальную популяцию из *п* хромосом.
  - 2. Вычисляем для каждой хромосомы ее пригодность.
  - 3. Выбираем пару хромосом-родителей с помощью одного из способов отбора.
  - 4. Проводим *кроссинговер* двух родителей с вероятностью *рс,* производя двух потомков.
  - 5. Проводим мутацию потомков с вероятностью *p*m.
  - 6. Повторяем шаги 3–5, пока не будет сгенерировано новое поколение
  - популяции, содержащее п хромосом.
  - 7. Повторяем шаги 2–6, пока не будет достигнут критерий окончания процесса.

## Кодирование

• Как правило, в хромосоме кодируются численные параметры решения. Для этого возможно использование целочисленного и вещественного кодирования

**Целочисленное кодирование.** В каноническом генетическом алгоритме хромосома представляет собой битовую строку, в которой закодированы параметры решения поставленной задачи. Ниже показан пример кодирования 4-х 10-разрядных параметров в 40 разрядной хромосоме. Как правило, считают, что каждому параметру соответствует свой *ген*. Таким образом, можно также сказать, что хромосома на рис. состоит из 4-х 10-разрядных генов.



• Представление числовых значений Стандартное двоичное представление целых чисел неудобно для генетических алгоритмов тем, что небольшие изменение числового значения может приводить к существенному изменению стр 7 ↔ 0111; 8 ↔ 1000; редставления, и наоборот.

Поэтому обычно используется (рефлексивная двоичная) кодировка Грея.

### Коды Грея

Пусть  $s = (s_1, s_2, ..., s_n)$  — стандартное двоичное представление числа,  $b = (b_1, b_2, ..., b_n)$  — представление того же числа в кодировке Грея.

Преобразование из стандартного представление в коды Грея:

$$b_k = \begin{cases} s_1, \text{ если } k = 1; \\ s_k \oplus s_{k-1}, \text{ если } k > 1, k = \overline{1, n}. \end{cases}$$

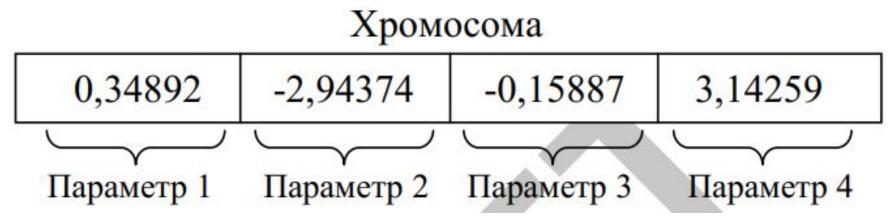
Преобрезование из кода Грея в стандартное представление.

$$s_k = \bigoplus_{i=1}^k b_i, \quad k = \overline{1, n},$$

Десятичные числа	Двоичный код	Код Грея	Десятичные числа	Двончныи код	Код Грев
0	0000	0000	8	1000	1100
1	1000	0001	9	1001	1101
2	0010	0011	10	1010	1111
3	0011	0010	11	1011	1110
4	0100	0110	12	1100	1010
5	0101	0111	13	1101	1011
6	0110	0101	14	1110	1001
7	0111	0100	15	1111	1000

## Вещественное кодирование.

• Часто бывает удобнее кодировать в гене не целое число, а вещественное. Это позволяет избавиться от операций кодирования/декодирования, используемых в целочисленном кодировании, а также увеличить точность найденного решения. Пример вещественного кодирования представлен ниже.



# Скрещивание

• Скрещивание (кроссовер, кроссинговер)
Построение новых решений за счёт рекомбинации фрагментов

имеющихся решений. Порядок выполнения: 1. Выбрать множество родительских хромосом (как правило, 2 ШТ).

2. Скрестить их между собой — получить хромосомы нового

поколения.

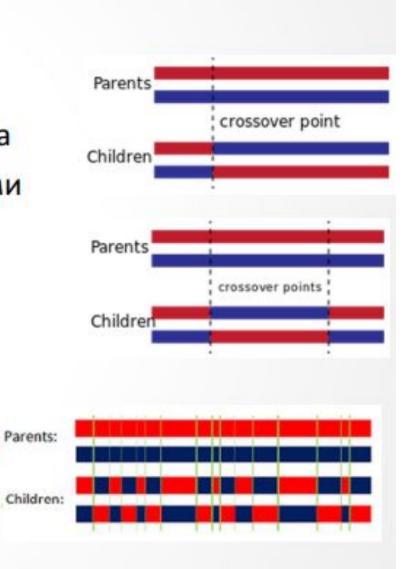
- Варианты выбора пар хромосом:
   выбирается *k* случайных пар из популяции
  - равновероятно;
- вероятность объединения хромосом в пары зависит от сходства их генотипов (представлений)ж
- вероятность объединения хромосом в пары зависит от сходства их фенотипов (решений),
- вся популяция случайно разбивается на пары, каждая пара скрещивается с вероятностью рс

# Варианты оператора кроссовера в случае целочисленного кодирования

#### Варианты оператора скрещивания:

- Одноточечное скрещивание
  - Случайно выбирается позиция разрыва
  - Фрагменты хромосом меняются парами
- Двухточечное скрещивание

- Однородное скрещивание
  - Каждый ген с заданной вероятностью остаётся в «родной» хромосоме или переходит в другую



## Скрещивание (кроссовер, кроссинговер)

Для представления в виде перестановки (задача коммивояжёра) лучше

подходят операторы скрещивания, старающиеся сохранить относительный порядок элементов. Например — порядковый оператор скрещивания (ОХ):

1) Одну из родительских хромосом считаем «разрезаемой», другую

«заполняемой». Потом ,для формирования другого потомка, меняем

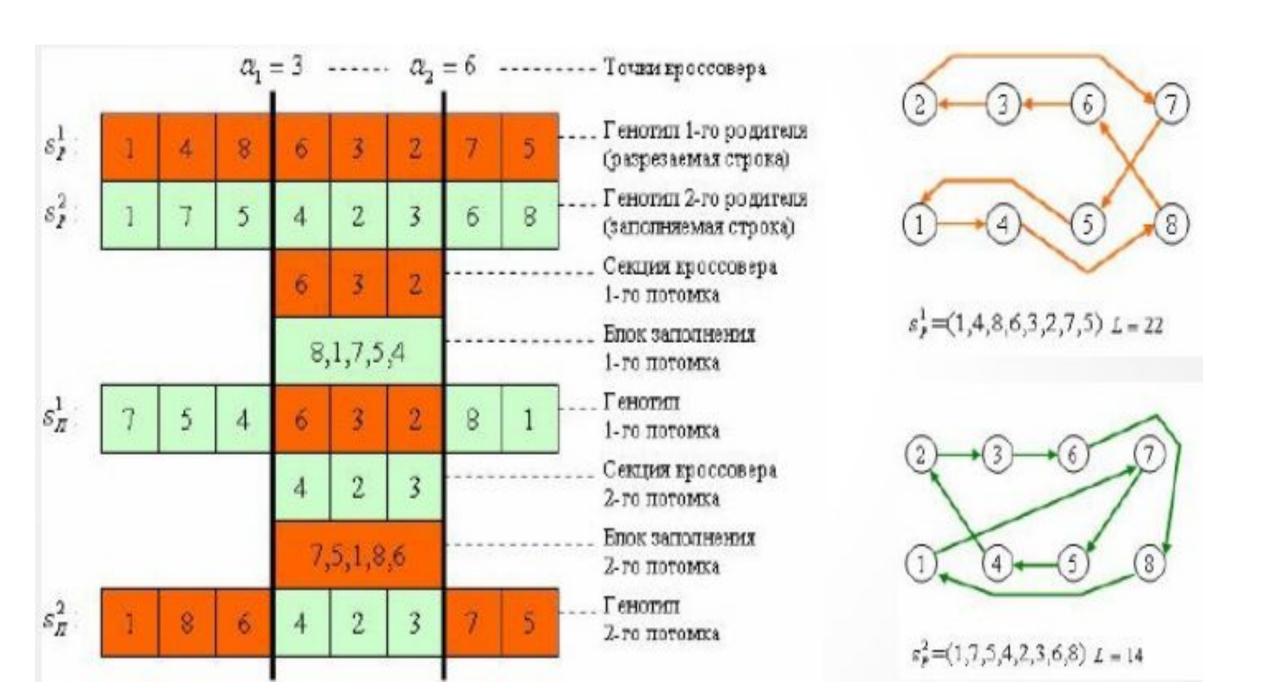
«роли» хромосом. 2) Случайно выбираем две точки. 3) Фрагмент разрезаемой хромосомы переносим в потомка на те же позиции.

4) Из заполняемой хромосомы, начиная со второй точки разреза последовательно (и циклически) выбираем элементы, которых нет

В

перенесённом фрагменте (3). 5) Элементы последовательности (4) в том же порядке расставляем

незанятые позиции потомка, начиная сразу после второй точки naaneaa



# Варианты оператора кроссовера в случае вещественного кодирования

• Вещественное кодирование. Для вещественного кодирования рассмотрим 2-точечный, арифметический и *BLX*- α операторы кроссовера.

2-точечный кроссовер для вещественного кодирования, в целом, аналогичен 2-точечному кроссоверу для целочисленного кодирования. Различие заключается в том, что точка разрыва не может быть выбрана «внутри» гена, а

должна попасть ме Точки разрыва 1,11111 3,33333 -2,222224,44444 Родители -5,55555 6,66666 7,77777 -8,88888 1,11111 -2,222227,77777 4,44444 Потомки -5,55555 6,66666 3,33333 -8,88888 При использовании арифметического и BLX- $\alpha$  операторов обмен информацией между родительскими особями и потомками производится с учетом значений генов родителей.

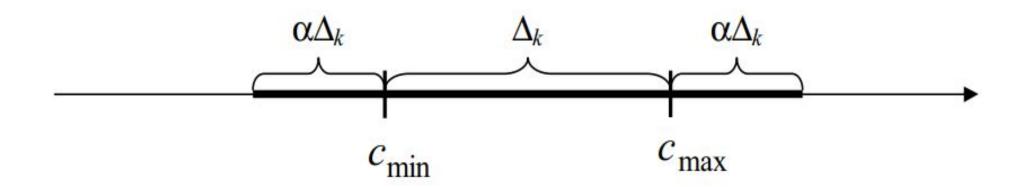
Обозначим  $g_k^{(1)}$  и  $g_k^{(2)} - k$ -е гены родительских особей,  $1 \le k \le N$ , N – количество генов в хромосоме. Пусть также  $h_k^{(1)}$  и  $h_k^{(2)} - k$ -е гены потомков. Тогда для арифметического кроссовера:

$$h_k^{(1)} = \lambda g_k^{(1)} + (1-\lambda)g_k^{(2)},$$
  $h_k^{(2)} = \lambda g_k^{(2)} + (1-\lambda)g_k^{(1)},$  где  $0 \le \lambda \le 1.$ 

Если используется BLX- $\alpha$  кроссовер, то значение k-го гена потомка выбирается случайным образом (равномерное распределение) из интервала [ $c_{min}$  –  $\alpha\Delta_k$ ,  $c_{max}$  +  $\alpha\Delta_k$ ], где  $\alpha$  – константа,

$$c_{\min} = \min\{g_k^{(1)}, g_k^{(2)}\},\$$
 $c_{\max} = \max\{g_k^{(1)}, g_k^{(2)}\},\$ 
 $\Delta_k = c_{\max} - c_{\min}.$ 

Изображение интервала, используемого для  $BLX-\alpha$  кроссовера показано



# Мутация

Независимое преобразование отдельных хромосом. Варианты операторов мутации:

- Случайно выбирается хромосома, в ней случайно выбирается изменяемый ген
- Во всех хромосомах каждый ген меняется с вероятностью *pm*

(«скорость мутации»). Для двоичного представления:  $0 \longleftrightarrow 1$ .

$$x_1x_2 \dots x_{n-1}x_nx_{n+1}\dots x_m \longrightarrow x_1x_2\dots x_{n-1}\bar{x}_nx_{n+1}\dots x_m$$

Иногда используются альтернативные варианты мутаций. Для случая, когда хромосома представляет собой перестановку (задача коммивояжёра), мутация тоже может выполняться в виде

перестановки:

- Транспозиция случайной пары позиций в хромосоме.
- Сдвиг случайно выбранного гена на случайное количество позиций; промежуточные гены смеща.тся на 1 позицию в противоположном направлении.
- Инверсия: случайным образом выбирается фрагмент хромосомыи инвертируется (записывается в обратном порядке)

При вещественном кодировании к генам в процессе мутации может добавляться случайный шум.

# Отбор

С помощью операции отбора (селекции) формируется новое поколение популяции. Отбор выполняется случайным образом на

основе приспособленности каждой хромосомы — более приспособленные хромосомы имеют больше шансов выжить. Классический вариант отбора:

- рассчитать для каждой хромосомы её приспособленность (fittness) *fi*
- рассчитать среднее значение приспособленности: fc
- для каждой хромосомы в новую популяцию попадает:
- $-\inf(fi/fc)$  копий этой хромосомы
- ещё одна копия с вероятностью {fi / fc}

Альтернативные варианты отбора
Используются для предотвращения двух проблем
классического
отбора: а) преждевременной сходимости (при появлении
особей с экстремально высокой приспособленностью), б)
потерей

чувствительности (при приближении к оптимуму).

• Ранговый отбор

Аналогичен классическому, но вместо приспособленности хромосомы/особи используется её ранг — порядковый номер в

упорядоченной (по приспособленности) последовательности.

• Турнирный отбор

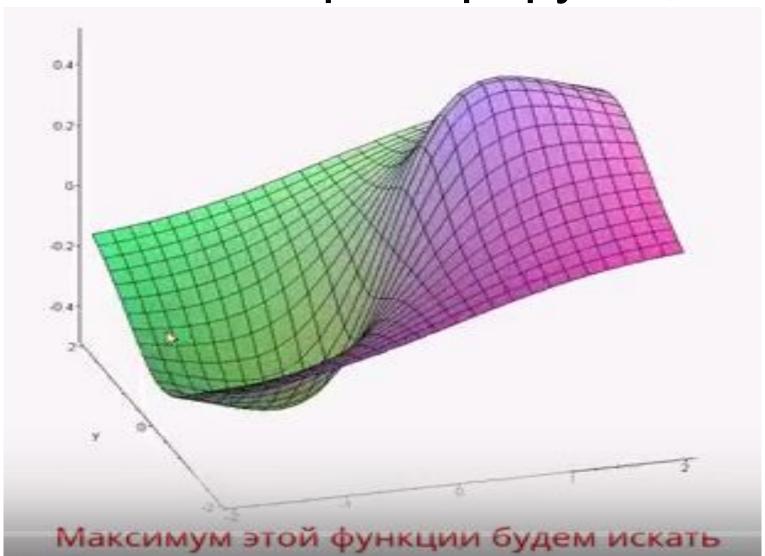
Для выбора N хромосом проводится N турниров. Для каждого турнира случайно выбираются k хромосом и в новое поколение отбирается наилучшая из них.

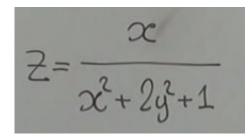
# Формирование поколений

Классический подход: все потомки объединяются вместе с предками в одно множество из 2N особей, из этого множества выбирается новое поколение. Варианты:

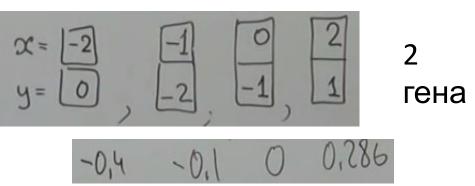
- При отборе учитывается «генетическое разнообразие»: из множества особей с одинаковой приспособленностью выбираются максимально отличающиеся по генотипу.
- Элитный отбор: гарантированно выживают *k* наилучших решений, остальные отбираются каким-то другим способом.

# Пример функции

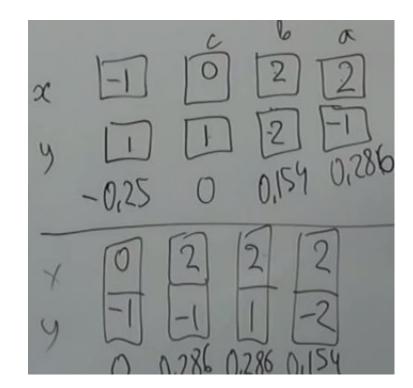


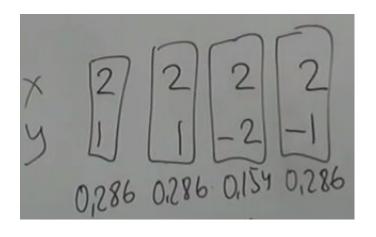


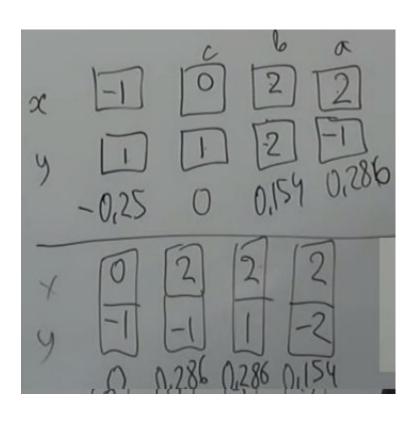
4 Хромосомы а

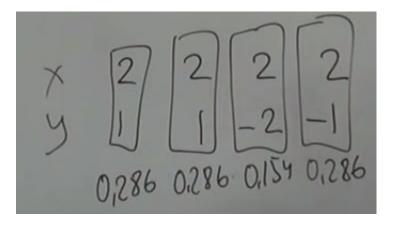








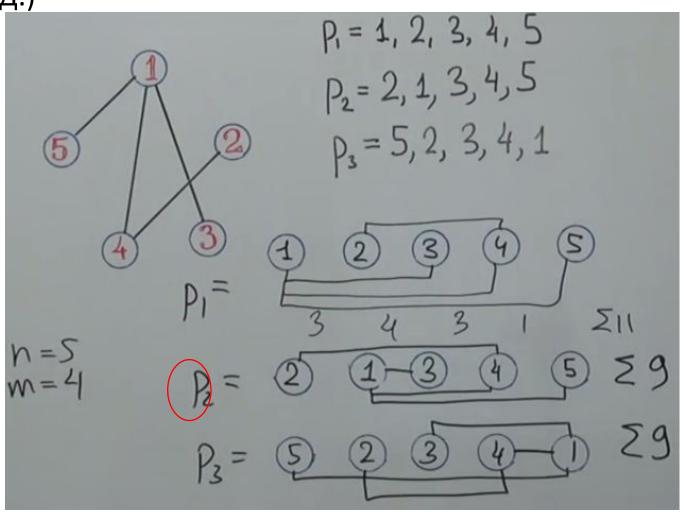


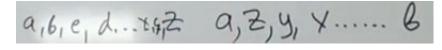


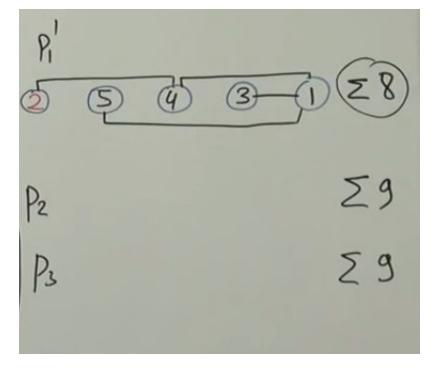
# Размещение графа на линейки

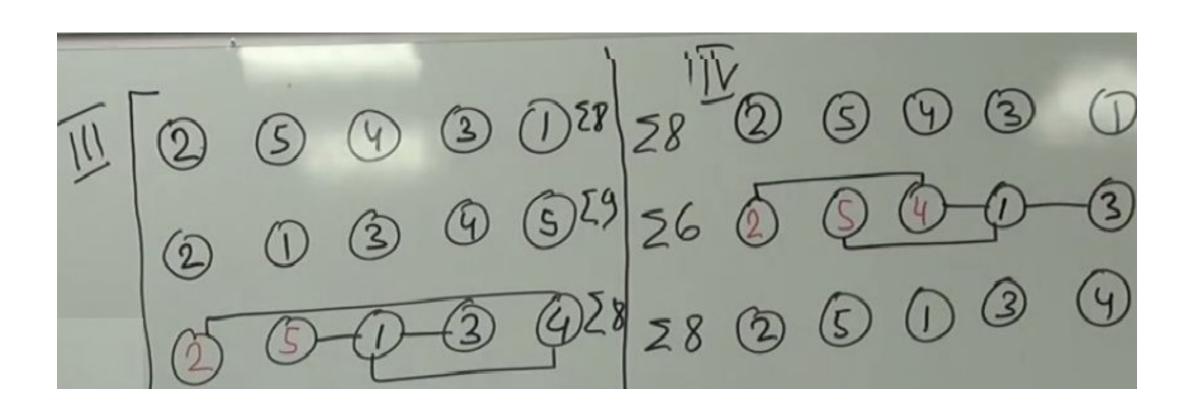
• За счет одних мутаций – инверсии по первым элементам (по 1, по 2 и т.

<u>д.)</u>





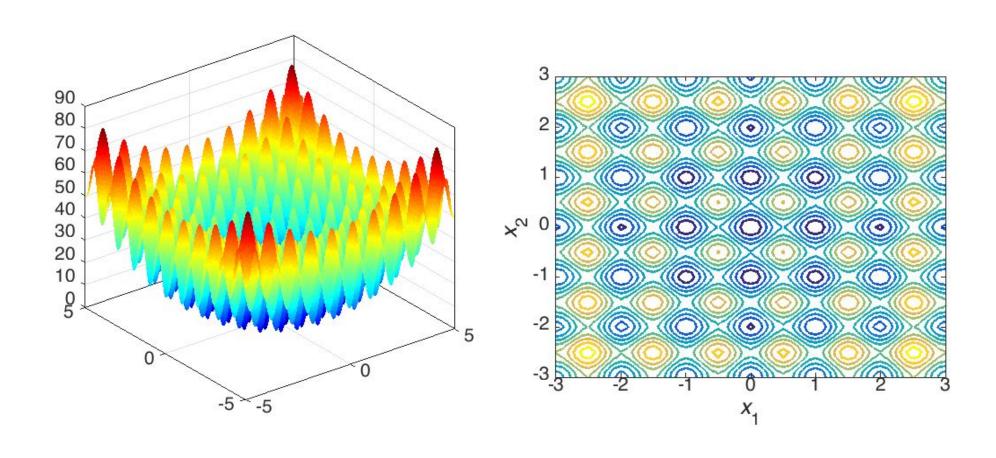




### Пример: функция

 $f(x_1,x_2)=20+x_1^2+x_2^2-10\cos(2\pi x_1)-10\cos(2\pi x_2)$ Имеет множество локальных минимумов и один глобальный Метод Левенберга-Марквардта и ему подобные зачастую находит

локальный минимум



#### Пример: функция

#### Шаг 1. Создание начальной популяции

$$x_1^{(0)} = x_2^{(0)} = 10$$

$$x_1^{(i)} = x_1^{(0)} + N_i(0; \sigma^2)$$

$$x_2^{(i)} = x_2^{(0)} + N_i(0; \sigma^2)$$

#### Шаг 2. Отбор

Целевая функция — значение функции Растригина для  $x_1^{(i)}$  и  $x_2^{(i)}$ 

#### Шаг 3. Скрещивание и мутации

Ведётся на основе лучших 5-10% членов популяции

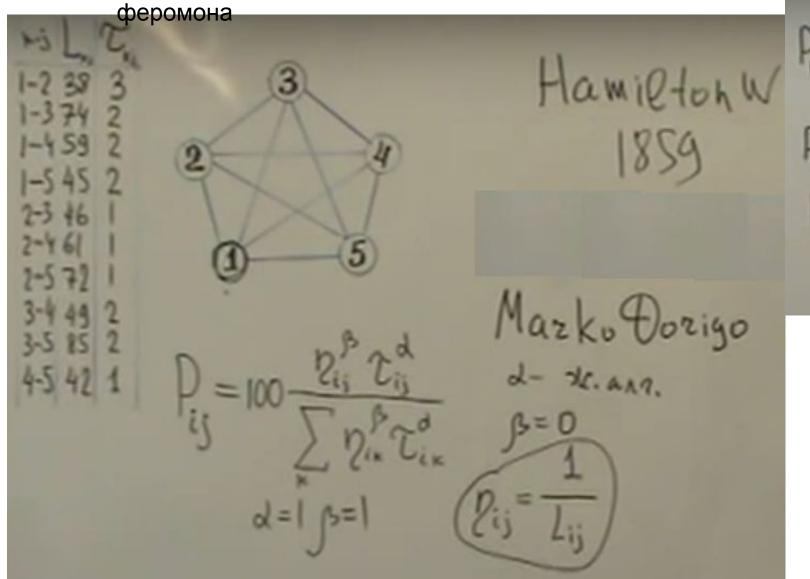
Скрещивание: 
$$\begin{cases} x_1^{(i)} = (1-w_1)x_1^{(m)} + w_1x_1^{(n)}; w_1 \in [0;1] \\ x_2^{(i)} = (1-w_1)x_2^{(m)} + w_2x_2^{(n)}; w_2 \in [0;1] \end{cases}$$
 Мутация: 
$$\begin{cases} x_1^{(i),*} = x_1^{(i)} + N(0;\sigma^2) \\ x_2^{(i),*} = x_2^{(i)} + N(0;\sigma^2) \end{cases}$$

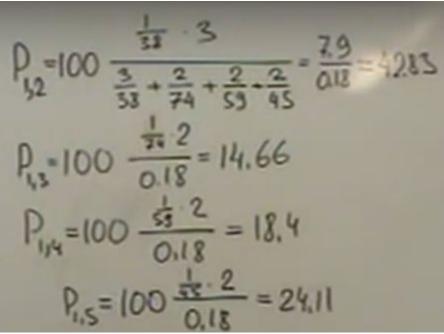
## Муравьиный алгоритм

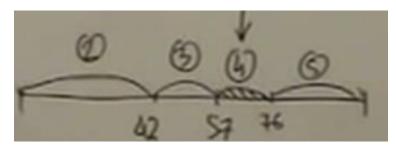
- Муравьиный алгоритм (алгоритм оптимизации подражанием муравьиной колонии, англ. ant colony optimization, ACO) один из эффективных полиномиальных алгоритмов для нахождения приближённых решений задачи коммивояжёра, а также решения аналогичных задач поиска маршрутов на графах. Суть подхода заключается в анализе и использовании модели поведения муравьёв, ищущих пути от колонии к источнику питания и представляет собой метаэвристическую оптимизацию. Первая версия алгоритма, предложенная доктором наук Марко Дориго в 1992 году, была направлена на поиск оптимального пути в графе.
- В основе алгоритма лежит поведение муравьиной колонии маркировка более удачных путей большим количеством феромона. Работа начинается с размещения муравьёв в вершинах графа (городах), затем начинается движение муравьёв направление определяется вероятностным методом

# Муравьиный алгоритм для задачи коммивояжера

т - колличество



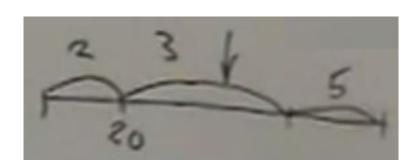




$$P_{4,2} = 100 \frac{1/61 \cdot 1}{1 + \frac{2}{49} + \frac{1}{42}} = 20.23$$

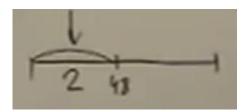
$$P_{4,3} = 100 \frac{2/49}{1 + \frac{2}{49} + \frac{1}{42}} = 50.38$$

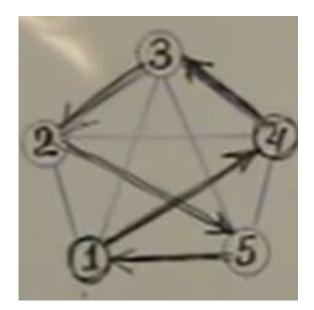
$$P_{4,5} = 100 \frac{1/42}{1 + \frac{2}{49} + \frac{1}{42}} = 23.39$$



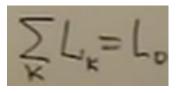
$$P_{3,2} = 100 \frac{\frac{1}{46} \cdot 1}{\frac{1}{46} + \frac{2}{85}} = 48,02$$

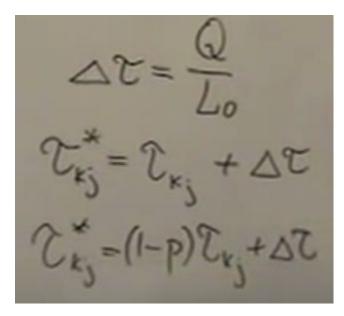
$$P_{3,5} = 100 \frac{\frac{2}{85}}{-100} = 51,98$$





#### Корректируем феромоны



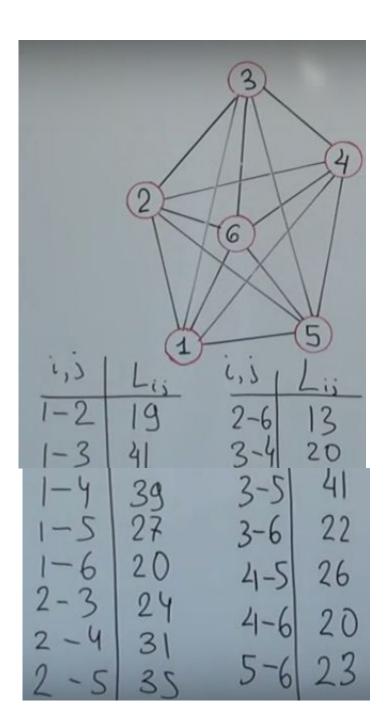


Q – константа

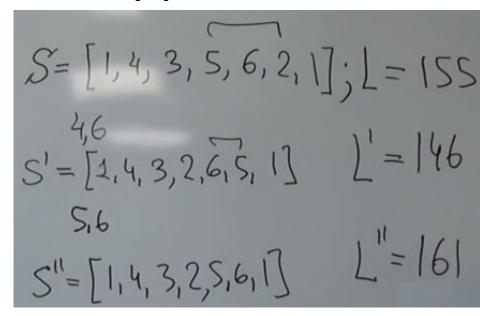
Р забывчивость

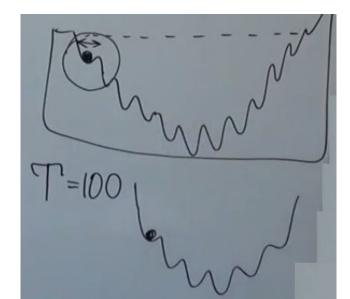
## Метод отжига

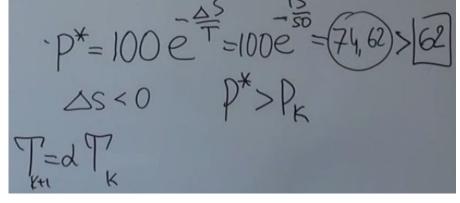
- **Алгоритм имитации отжига** (<u>англ.</u> Simulated annealing) общий алгоритмический метод решения задачи глобальной оптимизации, особенно дискретной и комбинаторной оптимизации. Один из примеров методов Монте-Карло.
- Алгоритм основывается на <u>имитации физического процесса</u>, который происходит при <u>кристаллизации вещества</u>, в том числе при <u>отжиге металлов</u>. Предполагается, что <u>атомы</u> уже выстроились в <u>кристаллическую решётку</u>, но ещё допустимы переходы отдельных атомов из одной ячейки в другую. Предполагается, что процесс протекает при постепенно понижающейся <u>температуре</u>. Переход атома из одной ячейки в другую происходит с некоторой <u>вероятностью</u>, причём вероятность уменьшается с понижением температуры.



# Метод отжига







ттемпература

$$(3,5)$$
 [1, 4,5,2,3,6,1] [= 166  
 $P^* > 100 e^{-25} - 81,84 < 83$ 

$$6,2$$
  
 $S = [1,6,3,2,5,4,1]$   
 $L = 166$   
 $P = 100e^{\frac{5}{12.5}}$