

Wintersemester 2007/08

**Praktische Optimierung**  
**(Vorlesung)**

Prof. Dr. Günter Rudolph

Fachbereich Informatik

Lehrstuhl für Algorithm Engineering





## Kapitel 1: Einleitung

---

### **Arbeitsdefinition:**

*Praktische Optimierung* =<sub>def</sub>

Was kann man tun, wenn

1. Problem nicht analytisch lösbar und
2. kein Lösungsalgorithmus bekannt.

⇒ Zu behandelnde **Fragestellungen:**

- Wie löst man Probleme analytisch?
- Welche Verfahren für bestimmte Problemklassen gibt es?
- Wie entwickelt man ein (heuristisches) Verfahren zur approximativen Lösung?



## Kapitel 1: Einleitung

---

### Problemklassen

hier:

- deterministisch, statisch
- deterministisch, statisch,  $\geq 2$  Zielsetzungen
- nicht-deterministisch, statisch
- deterministisch, dynamisch



## Kapitel 1: Einleitung

### Statisch, deterministisch

$$f(x; \theta) \rightarrow \min!$$

↑  
Parameter  $\in \mathbb{R}^p$

statisch : keine Änderungen über der Zeit  
deterministisch : alle Parameter sind Konstanten

**1. Ansatz:** Analytisch lösbar?  $f(\cdot)$  differenzierbar? Lösung herleitbar?

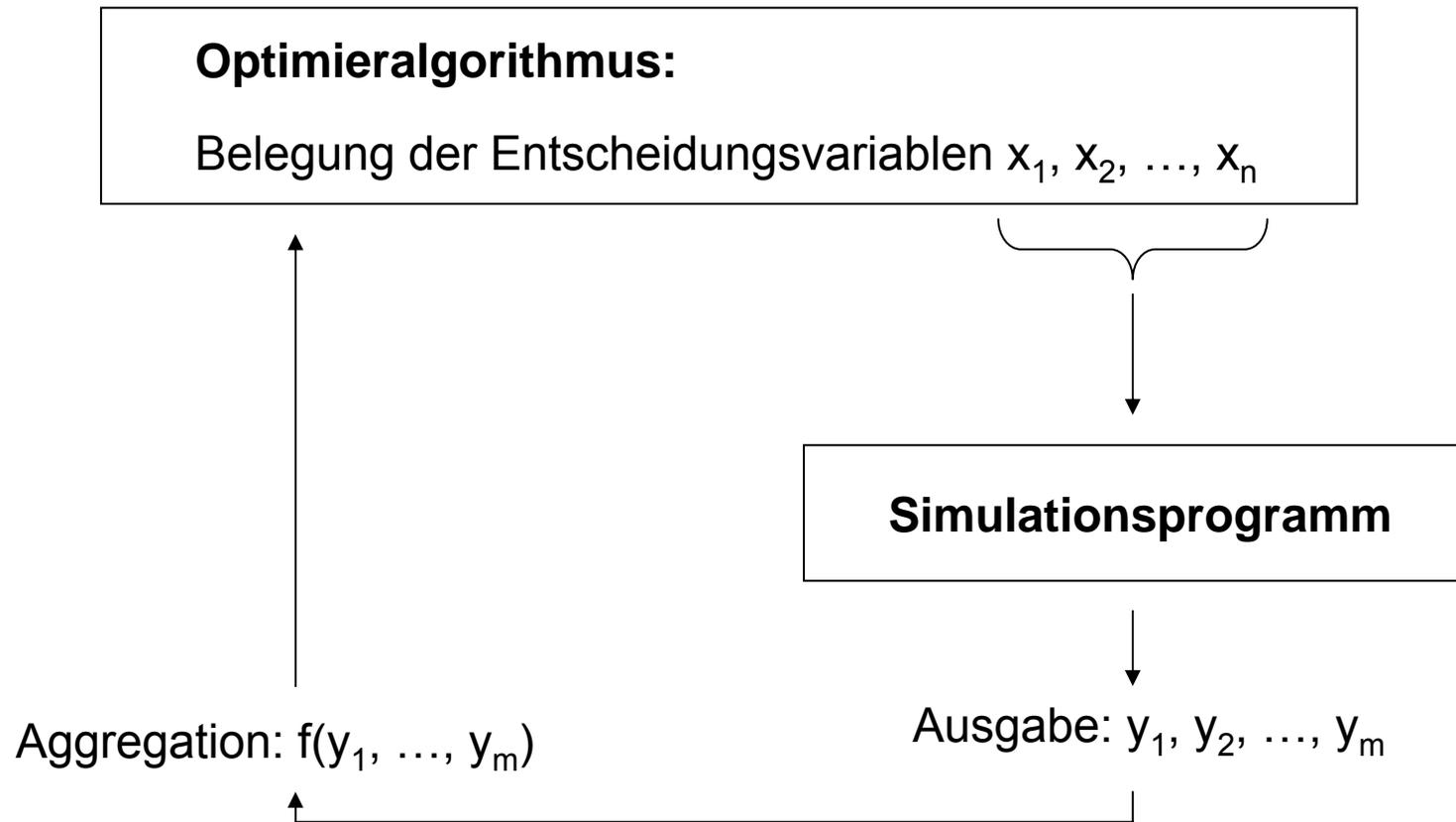
↙ ↘  
iterative Näherung?  $x^{(t+1)} = \text{ALG}(x^{(t)})$

↓  
Berechnung von  $f(\cdot)$  kann viel Zeit kosten!

z.B. bei technischen Anwendungen: Simulationslauf



## Kapitel 1: Einleitung



denkbar: „Metamodellierung“ von  $f(\cdot)$

**Idee:** erzeuge approximatives Modell von  $f(\cdot)$ , das schnell zu berechnen!



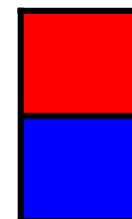
## Kapitel 1: Einleitung

### mehrfache Zielsetzung:

Beispiel: Brennstabwechselproblem (1994f.):

A565	A321	0232	B121	D099	A111	A121
A226	0321	C139	A982	C321	C021	A222
A987	A553	B111	B112	A002	A144	0128
A009	B454	0287	A801	B071	B522	
C343	D762	C424	0999	B991		
0292	D393	A632	0020			
A233	B987	C112				

gleichmäßiger Abbrand → max.  
hohe Energieleistung → max.



heiße / aktive Stäbe

kalte / inaktive Stäbe

Brennstabauswahl, -position und -orientierung

→ Simulator

Simulator rechnet ... (damals ca. 60s)

→ Ausgabe: 2 Werte



## Kapitel 1: Einleitung

### mehrfache Zielsetzung:

Was bedeutet hier „optimal“?

**1 Ziel** : Lösung  $x^*$ , so dass  $f(x^*)$  kleinster/größter Wert

**2 Ziele** : Lösung  $x^*$ , so dass  $f(x^*) \dots ?$

Problem: unvergleichbare Lösungen

Bsp:  $\begin{pmatrix} 3 \\ 6 \end{pmatrix} \preceq \begin{pmatrix} 4 \\ 7 \end{pmatrix}$  und  $\begin{pmatrix} 3 \\ 6 \end{pmatrix} \preceq \begin{pmatrix} 3 \\ 7 \end{pmatrix}$  aber  $\begin{pmatrix} 3 \\ 6 \end{pmatrix} \parallel \begin{pmatrix} 2 \\ 7 \end{pmatrix}$

⇒ neuer Optimalitätsbegriff nötig!

⇒ Pareto-Optimalität



## Kapitel 1: Einleitung

Was tun, wenn Physik / Chemie etc. des Prozesses unverstanden?

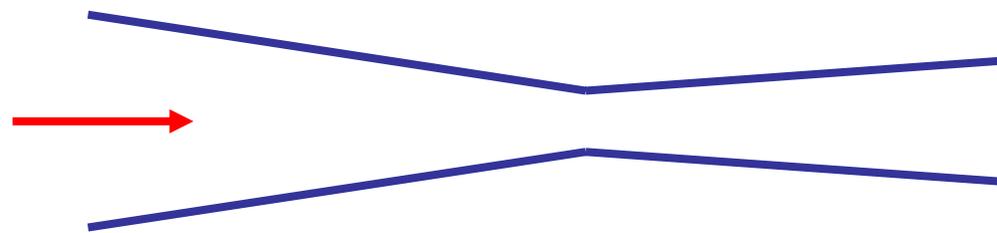
⇒ kein Simulationsprogramm verfügbar!

### **Ansatz:**

Optimierung am realen Objekt!

**Beispiel:** Zweiphasendüse (Schwefel, 1968)

Hochgeschwindigkeitdüse, turbulente Strömung, physikalisch nicht modellierbar

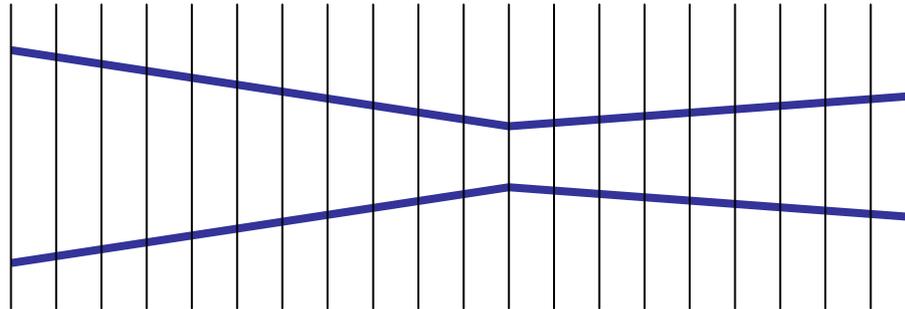


maximiere  
Wirkungsgrad



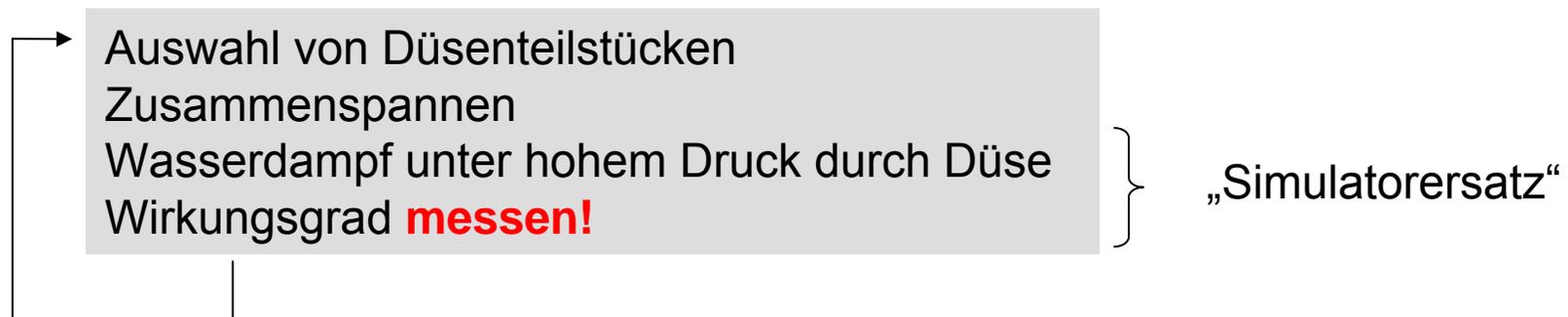
## Kapitel 1: Einleitung

### Versuchsaufbau:



Herstellung verschiedener konisch geformter Teilstücke / Segmente

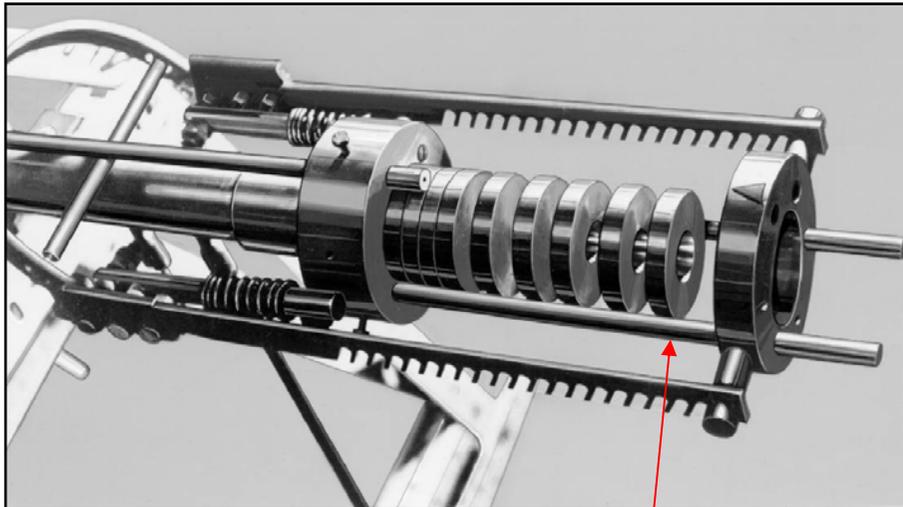
Form des Düsenteilstücks ist Entscheidungsvariable





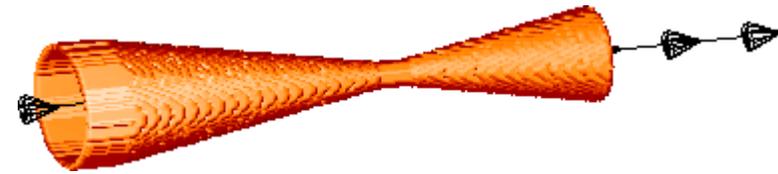
# Kapitel 1: Einleitung

Das reale Objekt:



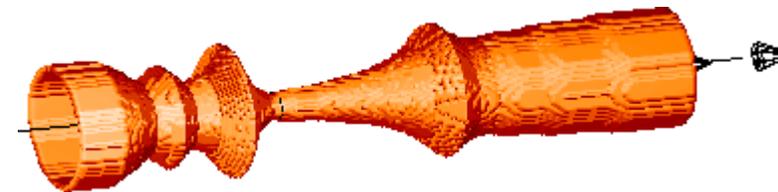
Segment

Startlösung:



Optimierte Lösung:

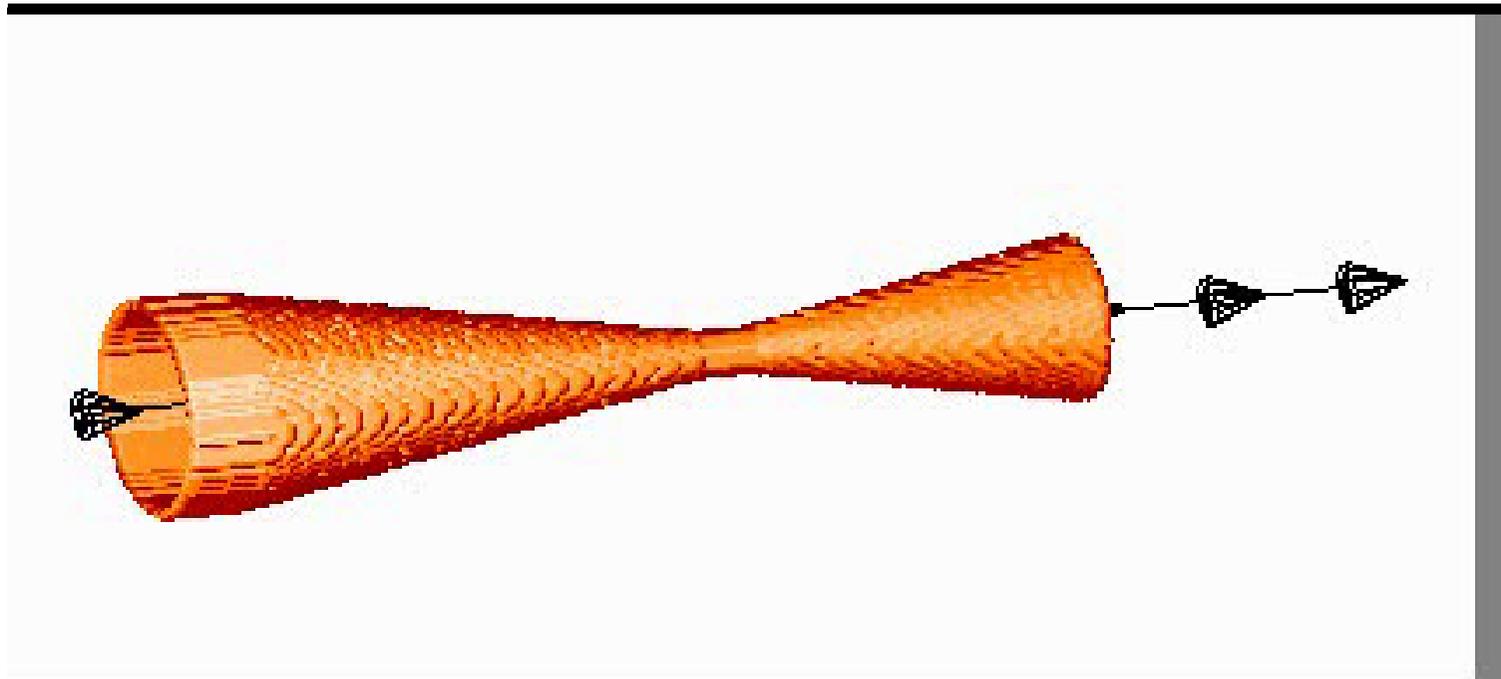
(nach 45 Verbesserungen)





## Kapitel 1: Einleitung

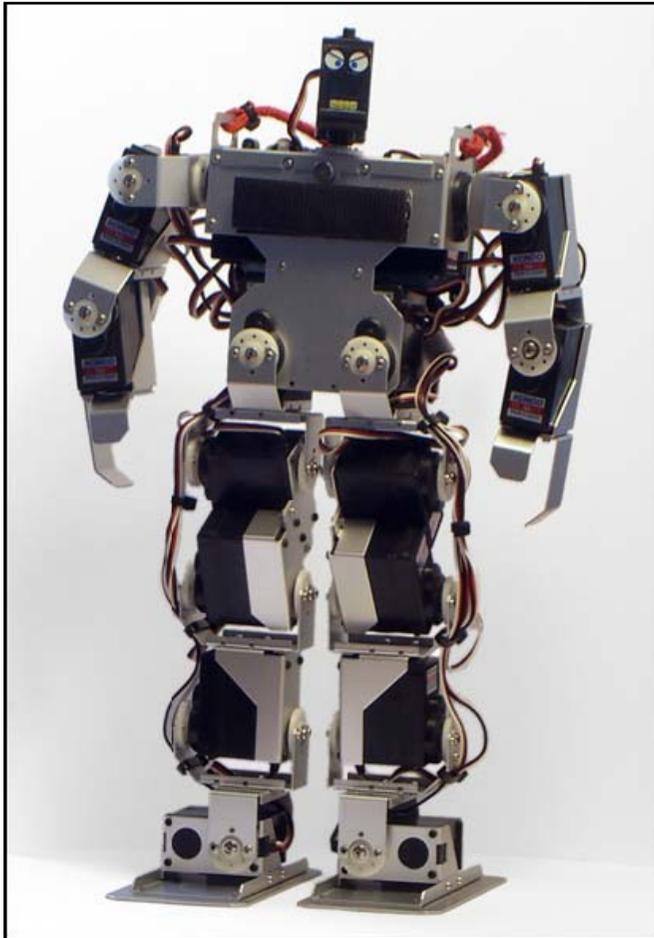
**Video:**





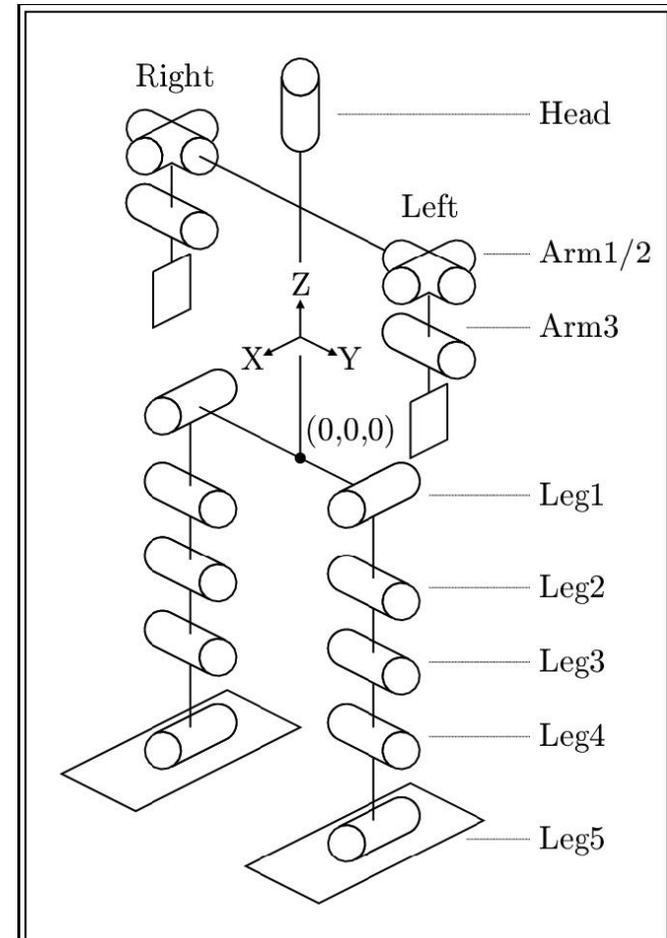
## Kapitel 1: Einleitung

### Neueres Beispiel: Humanoider Roboter soll laufen lernen!



Kondo KHR-1

Modell:





## Kapitel 1: Einleitung

### Ansatz:

- Physikalisches Modell des Laufens aufstellen

**Parametrisiert:** Wie hoch Fuß heben? Wie weit Arm schwingen? etc.

- Simulationsprogramm („*Walking Engine*“)
- Optimierungsalgorithmus variiert **Parameter**
- Optimalitätskriterium: Laufgeschwindigkeit (aus Simulation)

*Nach Optimierung:*

Parameter in den realen Roboter laden ...

**... und er fällt um, läuft schief, läuft langsam.**

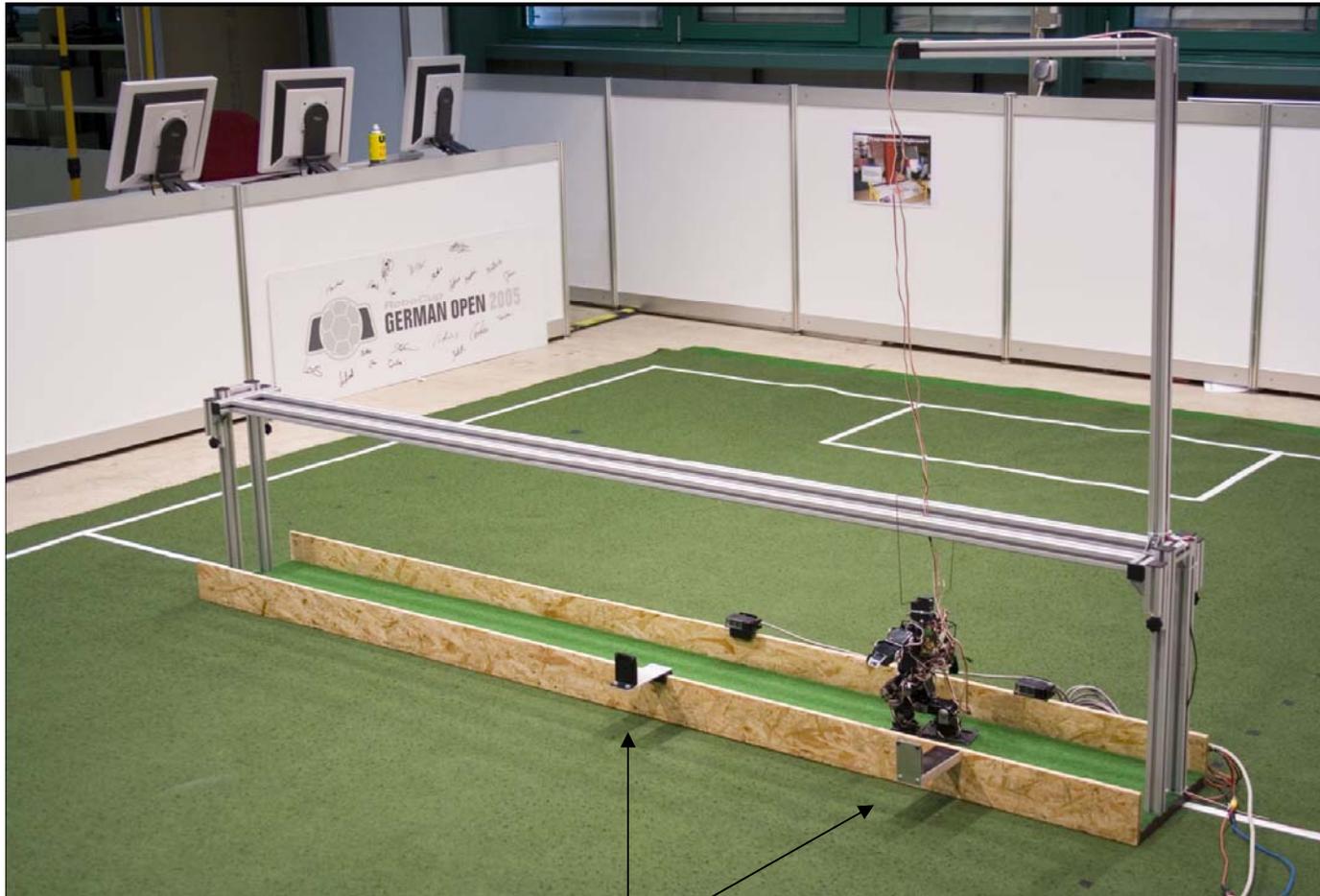


### Warum?

Modell und  
Simulation zu  
ungenau!



## Kapitel 1: Einleitung



Lichtschranken

### Aufbau:

1. Optimierer variiert Parameter
2. Download zum Robo
3. Läuft ...
4. Qualität = Zeit zwischen Lichtschranken



---

## Kapitel 1: Einleitung

---



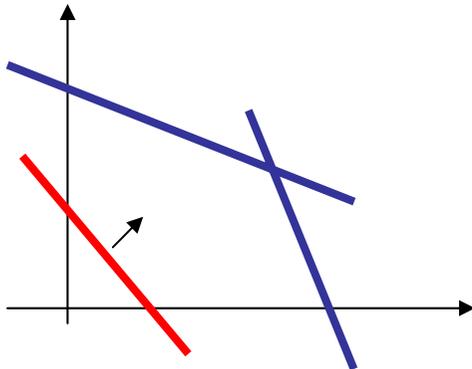
© Ralf Kosse: Diplomarbeit, Uni Dortmund, FB Informatik, IRF + LS11, September 2006.



## Kapitel 1: Einleitung

Was ist zu beachten, wenn Parameter des Problems **stochastisch**?

$$f(x) = c_1 x_1 + c_2 x_2 \quad \text{mit } A'x \leq b$$



$$f(x) = z = \text{const.}$$

- Wenn  $c_i$  in  $f(\cdot)$  Zufallsvariable (Zva):
  - ⇒  $f(\cdot)$  Zva
  - ⇒ Steigung zufällig
- Wenn Parameter in  $A$  und/oder  $b$  Zva:
  - ⇒ zulässiger Bereich zufällig
  - ⇒ zulässige (ggf. optimale) Lösung wird unzulässig!

Optimalitätsbegriff?



## Kapitel 1: Einleitung

---

Was kann man tun, wenn Parameter **zeitabhängig**?

⇒ das Optimum wandert im Raum!

- Optimum folgen ...
- Optimum vorhersagen ...

**Optimalitätsbegriff?**