

## درس ۲۹:

# بهینه سازی استوار

تهیه شده توسط گروه بهینه یاب



www.behinehyab.com

## مقدمه

در برنامه‌ریزی ریاضی معمولاً مسائل با پیش فرض قطعی بودن داده‌ها مدل‌سازی و حل می‌شوند. پیش فرض اصلی برنامه‌ریزی ریاضی در شرایط اطمینان<sup>۱</sup>، توسعه مدل بر اساس داده‌های **معین** و برابر با مقادیر اسمی<sup>۲</sup> است؛ در این گونه مدل‌ها اثر عدم اطمینان داده‌ها در کیفیت و امکان‌پذیری جواب‌ها تأثیری **ندارد**، در نتیجه در مسائل دنیای واقعی ممکن است با تغییر یکی از داده‌ها، تعداد زیادی از محدودیت‌ها نقض و جواب به دست آمده **غیر بهینه**<sup>۳</sup> یا **حتی غیر ممکن**<sup>۴</sup> شود. از این رو، چالش اصلی در این گونه مسائل، رسیدن به پاسخ مسئله است که در مقابل عدم اطمینان داده‌ها **استوار**<sup>۵</sup> باشد؛ به اصطلاح این جواب‌ها را جواب‌های استوار و این دسته از مسائل بهینه‌سازی‌ها را مسائل **بهینه‌سازی استوار**<sup>۶</sup> می‌نامند. نظریه برنامه‌ریزی یا بهینه‌سازی استوار روش ریسک‌گریزی را برای مواجهه با عدم اطمینان فراهم می‌سازد.

استواری به این مفهوم است که خروجی مدل نباید **حساسیت** زیادی به مقادیر دقیق پارامترهای ورودی داشته باشد. اهمیت این ویژگی در مدل‌ها باعث شده است که کاربرد بحث استواری در سال‌های اخیر در حوزه‌های مختلف با رشد فزاینده‌ای همراه شود. برنامه‌ریزی استوار در مباحث زمان‌بندی، مدیریت کیفیت، تخصیص منابع، طراحی سیستم‌های تولیدی، مدیریت زنجیره تأمین، تدوین استراتژی، حمل و نقل و مسائل مالی چشمگیر شده است. به طور کلی می‌توان مدل‌های معرفی شده در زمینه برنامه‌ریزی استوار را به **دو فهرست** کلی تقسیم بندی کرد.

**دسته اول** مدل‌هایی است که مبتنی بر سناریوهای **گسسته** تعریف می‌شود. در این مدل‌ها مقدار تابع هدف در هر یک از سناریوها باید اختلاف کمی با یکدیگر داشته باشند.

---

<sup>۱</sup> Certain

<sup>۲</sup> Nominal

<sup>۳</sup> Non-optimal

<sup>۴</sup> Infeasible

<sup>۵</sup> Robust

<sup>۶</sup> Robust optimization

**دسته دوم** نیز بر اساس مفهوم مجموعه های عدم اطمینان و مبتنی بر نوسان پارامترها در **یک بازه** است. در این مدل ها، عدم اطمینان در شکل مجموعه های عدم اطمینان کران دار مدل سازی می شود و هدف به دست آوردن جواب است که نسبت به تقریبا تمام پارامترهای عدم اطمینان حساسیت نداشته باشد. در واقع، پارامترهای پیوسته را می توان با رویکرد برنامه ریزی استوار در فواصل مشخصی محدود کرد و عدم اطمینان را در یک مجموعه مناسب جای داد.

جواب حاصل از این مدل جوابی است که نسبت به تغییرات داده های ورودی کمتر حساس است. در این نظریه یک راه حل برای یک مسئله بهینه سازی در صورتی استوار است که هم استوار **موجه** (استواری مدل) و هم استوار **بهینه** (استواری جواب) باشد.

**استواری موجه** به این معنی است که راه حل باید در محدودیت های مسئله برای تقریبا تمامی سناریوها **موجه** باقی بماند؛ برای این منظور در روش مطالعه مالوی<sup>۷</sup> و همکاران، ناموجه بودن جواب با یک تابع جریمه اندازه گیری می شود. موجه بودن جواب مستلزم این است که تابع جریمه دارای مقدار پایینی باشد. **استواری بهینگی** نیز به این معنی است که مقدار تابع هدف برای جواب مسئله باید نزدیک به مقدار بهینه باقی بماند یا دارای حداقل انحرافات نامطلوب از مقدار بهینه برای هر یک از مقادیر سناریوها باشد.

در تابع هدف مدل مالوی و همکاران برای استواری مدل و استواری جواب دارای جریمه هستیم که با توجه به ترجیح مدل ساز به هر یک از این **جریمه ها** وزن اختصاص می دهیم. روشن است که در این مدل، با توجه به ترجیحات تصمیم گیرنده، بین استواری جواب و استواری مدل باید تبادل صورت گیرد. نحوه فرموله سازی مدل بهینه سازی استوار مالوی و همکاران در ادامه آورده شده است.

<sup>۷</sup> Mulvey

مدل برنامه‌ریزی خطی با پارامترهای تصادفی زیر را در نظر بگیرید:

$$\text{Min } c^T x + d^T y$$

$$\text{s.t. } Ax = b,$$

$$Bx + Cy = e$$

$$x \geq 0, y \geq 0$$

متغیر  $x$  برداری از متغیرهای طراحی و متغیر  $y$  نیز برداری از متغیرهای کنترل است. پارامترهای  $A$ ،  $B$  و  $C$  ماتریس پارامترها و  $b$  و  $e$  نیز بردار پارامترها هستند. همچنین  $A$  و  $b$  مشخص و  $B$ ،  $C$  و  $e$  نادقیق هستند.

تحقق هر مقدار برای پارامتر نادقیق یک سناریو نامیده می‌شود، که با  $s$  نشان داده و احتمال آن با  $p_s$  آورده می‌شود ( $\sum_{s=1}^s p_s = 1$ ). برای نمایش مجموعه سناریوها از  $\Omega = \{1, 2, \dots, S\}$  استفاده می‌کنیم. ضرایب نادقیق  $B$ ،  $C$  و  $e$  را نیز به صورت  $B_s$ ،  $C_s$  و  $e_s$  برای هر سناریو  $s \in \Omega$  نشان می‌دهیم. همچنین، متغیر کنترل  $y$  نیز که در زمان تحقق یک سناریو در معرض تعدیل قرار می‌گیرد، به صورت  $y_s$  برای سناریو  $s$  نشان داده می‌شود. مدل بهینه‌سازی استوار تصادفی به صورت زیر فرموله می‌شود:

$$\text{Min } \gamma(x, y_1, y_2, \dots, y_s) + \omega p(\eta_1, \eta_2, \dots, \eta_s) \quad (1)$$

$$\text{s.t. } Ax = b, \quad (2)$$

$$B_s x + C_s y_s + \eta_s = e_s, \quad \forall s \in \Omega, \quad (3)$$

$$x \geq 0, y_s \geq 0, \eta_s \geq 0, \forall s \in \Omega, \quad (4)$$

به دلیل نادقیق بودن پارامترها، مدل ممکن است برای برخی سناریوها ناموجه باشد. مجموعه  $(\eta_1, \dots, \eta_s)$  شامل بردارهای خطا است که اندازه ناموجه بودن در محدودیت‌های کنترل (۳) برای سناریو  $s$  را اندازه‌گیری می‌کند. در صورت موجه بودن مدل برای سناریو  $s$ ،  $\eta_s$  برابر با صفر خواهد بود؛ در غیر این صورت،  $\eta_s$  در محدودیت (۳) مقدار مثبتی خواهد بود. در مدل بالا، تابع هدف مدل اول ( $\xi = c^T x + d^T y$ ) که می‌

تواند تابع سود یا هزینه باشد، تبدیل به متغیر تصادفی به صورت  $\xi_s = c^T x + d_s^T y_s$  می شود که متوسط آن به ازای سناریوها، سود یا هزینه مورد انتظار نامیده می شود.

در مدل بالا، تابع هدف دارای دو قسمت شامل استواری جواب و استواری مدل است که وزن **قسمت اول** با  $\gamma$  (گاما) و وزن **قسمت دوم** با  $\omega$  (امگا) مشخص می شود.

در **قسمت اول** که استواری جواب را در نظر می گیرد، از  $\xi_s$  برای نمایش تابع هزینه یا سود  $f(x, y_s)$  استفاده می کنیم. از این رو،  $\xi_s = f(x, y_s)$  را برای سناریو  $s$  داریم. واریانس یا  $\sigma(\bullet)$  بزرگ برای متغیر تصادفی  $\xi_s = f(x, y_s)$  به معنی بالا بودن ریسک این جواب خواهد بود. در این صورت، یک تغییر کوچک در مقدار پارامترهای نادقیق مدل می تواند باعث یک تغییر بزرگ در مقدار تابع هدف شود. برای این قسمت، مالوی و همکاران از رابطه زیر استفاده کردند:

$$\sigma(\bullet) = \sum_{s \in \Omega} p_s \xi_s + \gamma \sum_{s \in \Omega} p_s \left( \xi_s - \sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'} \right)^2 \quad (5)$$

$\gamma$  وزن تغییر پذیری جواب را نشان می دهد. در این عبارت، با عبارت **درجه دوم**  $\sum_{s \in \Omega} p_s \left( \xi_s - \sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'} \right)^2$

نیاز به عملیات محاسباتی زیادی داریم. برای حل این مشکل، از **قدر مطلق** انحرافات به جای عبارت بالا می توان استفاده کرد که به صورت زیر بازنویسی می شود:

$$\sigma(\bullet) = \sum_{s \in \Omega} p_s \xi_s + \gamma \sum_{s \in \Omega} p_s \left| \xi_s - \sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'} \right| \quad (6)$$

با توجه به غیر خطی بودن فرم قدر مطلق انحرافات، می توان با معرفی دو متغیر انحرافی غیر منفی  $Q_s^+$  و  $Q_s^-$ ، فرم غیر خطی را به فرم خطی تبدیل کرد و به جای حداقل سازی قدر مطلق انحرافات، این دو متغیر را با در نظر گرفتن محدودیت های اصلی و محدودیت های اضافی، حداقل ساخت. این محدودیت اضافی باعث می شود اختلاف درون قدر مطلق مقدار مثبتی بگیرد. بر این اساس، مسئله برنامه ریزی **غیر خطی** بالا به صورت **خطی** بازنویسی می شود:

$$\text{Min} \sum_{s \in \Omega} p_s \xi_s + \gamma \sum_{s \in \Omega} p_s (Q_s^+ + Q_s^-) \quad (7)$$

$$\text{s.t. } \xi_s - \sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'} = Q_s^+ - Q_s^- \quad s \in \Omega \quad (8)$$

$$Q_s^+, Q_s^- \geq 0, s \in \Omega \quad (9)$$

روشن است که برای  $\gamma > 0$ ، حداقل یکی از  $Q_s^+$  و  $Q_s^-$  صفر خواهد شد. به عبارت دیگر، در صورت بزرگ

بودن  $\xi_s$  از  $\sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'}$ ،  $Q_s^+$  مقداری مثبت و  $Q_s^-$  برابر با صفر و در صورت کوچک تر بودن  $\xi_s$  از  $\sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'}$

،  $Q_s^-$  مقداری مثبت و  $Q_s^+$  برابر با صفر خواهد بود. دقت کنید که  $Q_s^+ + Q_s^- = \left| \xi_s - \sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'} \right|$

است.

به زعم یو و لی<sup>۱</sup> (۲۰۰۰)، در روش خطی سازی بالا، با معرفی متغیرهای انحرافی غیر منفی، محدودیت های

زیادی به مدل تحمیل می شود. برای این منظور، یو و لی از یک روش کارا برای خطی سازی فرم قدر مطلق

انحرافات به صورت زیر استفاده کرده اند:

$$\text{Min } \sum_{s \in \Omega} p_s \xi_s + \gamma \sum_{s \in \Omega} p_s \left[ \left( \xi_s - \sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'} \right) + 2\theta_s \right] \quad (10)$$

$$\text{s.t. } \xi_s - \sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'} + \theta_s \geq 0 \quad (11)$$

$$\theta_s \geq 0 \quad (12)$$

در **قسمت دوم**، از تابع جریمه  $(\omega p(\eta_1, \eta_2, \dots, \eta_s))$ ، برای دادن جریمه به ناموجه بودن مدل استفاده می

شود که استواری مدل را اندازه گیری می کند.  $\omega$  وزن غیر موجه بودن مدل را نشان می دهد و با پارامتر  $\gamma$

تبادل بین استواری جواب و مدل را کنترل می کند. در مسئله ای که در ادامه آورده خواهد شد،  $\eta_s$  که

ناموجه بودن مدل را نشان می دهد، تقاضای برآورده نشده در سناریو  $s$  خواهد بود. تابع جریمه، مقدار مورد

انتظار بردار خطا  $\eta_s$  خواهد بود که به صورت زیر نشان داده می شود:

$$\rho(\bullet) = \sum_{s \in \Omega} p_s \eta_s \quad (13)$$

در نهایت، مدل برنامه ریزی استوار تصادفی به صورت زیر فرموله می شود:

<sup>۱</sup> Yu and Lee

$$\text{Min} \sum_{s \in \Omega} p_s \xi_s + \gamma \sum_{s \in \Omega} p_s \left[ \left( \xi_s - \sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'} \right) + 2\theta_s \right] + \omega \sum_{s \in \Omega} p_s \eta_s \quad (14)$$

$$\text{s.t.} \quad Ax = b, \quad (15)$$

$$B_s x + C_s y_s + \eta_s = e_s, \quad \forall s \in \Omega \quad (16)$$

$$\xi_s - \sum_{s' \in \Omega} p_{s'} \xi_{s'} + \theta_s \geq 0 \quad s \in \Omega \quad (17)$$

$$\theta_s \geq 0, x \geq 0, y_s \geq 0, \eta_s \geq 0, \forall s \in \Omega,$$

### مبانی مدل سازی بهینه سازی استوار

نظریه بهینه سازی استوار چهارچوبی را برای مواجهه با عدم اطمینان پارامترها در مسائل بهینه سازی فراهم می سازد، به طوری که می توان جواب بهینه را برای وقوع عدم اطمینان در یک مجموعه عدم اطمینان **کران دار** معین ایمن نگاه داشت. اولین گام در راستای توسعه نظریه بهینه سازی استوار را **سویستر**<sup>۹</sup> (۱۹۷۳) برداشته است. رویکرد سویستر برای مواجهه با عدم اطمینان ستون محور در فواصل پیشنهاد شده است؛ این رویکرد بهترین نتایج ممکن را برای هر یک از پارامترهای نادقیق در نظر می گیرد و جواب استواری را ارائه می کند که برای همه داده های نادقیق موجه است؛ با این حال این جواب **خیلی محافظه کارانه** است و مقدار تابع هدف را **خیلی بدتر** از تابع هدف با داده های اسمی ارائه می دهد.

بعد از دو دهه، بن تال و نمیروفسکی<sup>۱۰</sup> (۱۹۹۸) و ال قاوی<sup>۱۱</sup> و همکاران (۱۹۹۸) با معرفی مدل هایی برای مسائل خطی نادقیق با عدم اطمینان های بیضی و حال همتای مسائل اسمی در فرم مسائل درجه دوم مخروطی، گامی موثر در این مسیر برداشتند. بن تال و نمیروفسکی عدم اطمینان سطر محور با ساختار عدم اطمینان بیضی را برای اجتناب از سناریوی بدترین مورد (که خیلی غیر محتمل است) بررسی کردند و

<sup>۹</sup> Soyster

<sup>۱۰</sup> Ben-tal and Nemirovski

<sup>۱۱</sup> El Ghaoui

**همتای<sup>۱۲</sup>** استواری جدیدی را برای مسئله برنامه‌ریزی خطی توسعه دادند که در آن یک حد بالایی برای تخطی از محدودیت در نظر گرفته می‌شود. رویکرد پیشنهادی نسبت به رویکرد سویستر **کمتتر** محافظه کارانه، اما مدل حاصله **غیر خطی** بوده است و در نتیجه برای حل مدل‌های بهینه‌سازی **گسسته** استوار مستقیماً کاربردی نیست.

برتسیماس و سیم<sup>۱۳</sup> (۲۰۰۴) رویکرد دیگری برای نمایش عدم اطمینان پارامترها توسعه داده‌اند. آن‌ها کران‌هایی را برای پارامترهای عدم اطمینان در نظر گرفتند که از مقدار اسمی خود متفاوت‌اند. این رویکرد خانواده‌ای از همتای استوار را ارائه می‌کند که ویژگی انعطاف‌پذیری دارد. رویکرد پیشنهادی این نویسندگان دارای ویژگی‌های زیر است:

۱. امکان تنظیم سطح حفاظت برای تبادل بین عملکرد و استواری وجود دارد.
  ۲. امکان محاسبه تضمین احتمال برای ارضای محدودیت‌ها وجود دارد، به طوری که این ضمانت احتمال به جواب مدل استوار وابسته نیست.
  ۳. این رویکرد برای مسائل بهینه‌سازی گسسته قابل استفاده است.
- در بهینه‌سازی استوار مبتنی بر مجموعه‌های کراندار، فرض می‌شود داده‌های عدم اطمینان در یک مجموعه عدم اطمینان معین توزیع شده‌اند و هدف انتخاب بهترین جواب از بین جواب‌هایی است که در برابر عدم اطمینان داده‌ها مصون یا موجه هستند. توزیع‌های عدم اطمینان داده‌ها می‌تواند یکی از توزیع‌های پیوسته مانند توزیع یکنواخت، نرمال و گسسته مانند دوجمله‌ای و پواسن را به خود بگیرد.
- مسئله بهینه‌سازی خطی عدد صحیح زیر را در نظر بگیرید:

$$\text{Max} \sum_m c_m x_m + \sum_k d_k y_k \quad (17)$$

$$\text{s.t.} \sum_m \tilde{a}_{im} x_m + \sum_k \tilde{b}_{ik} y_k \leq \tilde{p}_i \quad \forall i \quad (18)$$

<sup>۱۲</sup> Counterpart

<sup>۱۳</sup> Bertsimas and Sim



$$\tilde{a}_{im} = a_{im} + \xi_{im} \hat{a}_{im}, \quad \forall m \in M_i \quad (19)$$

$$\tilde{b}_{ik} = b_{ik} + \xi_{ik} \hat{b}_{ik}, \quad \forall k \in K_i \quad (20)$$

$$\tilde{p}_i = p_i + \xi_{i0} p_i \quad (21)$$

متغیرهای  $X$  و  $Y$  به ترتیب متغیرهای پیوسته و عدد صحیح هستند.  $M_i$  و  $K_i$  زیرمجموعه هایی هستند که به ترتیب متغیرهای پیوسته و گسسته را در بر دارند. ضرایب متغیرهای  $X$  و  $Y$  در معرض عدم اطمینان قرار دارد.  $\xi$  پارامترهای نادقیق مستقلی هستند که در بازه  $[-1, 1]$  توزیع می شوند،  $\xi$  اُمین محدودیت مسئله اولیه بالا، محدودیت (۱۸)، به صورت زیر بازنویسی می شود:

$$\sum_{m \in M_i} a_{im} x_m + \sum_{k \in K_i} b_{ik} y_k + \sum_{m \in M_i} \tilde{a}_{im} x_m + \sum_{k \in K_i} \tilde{b}_{ik} y_k \leq \tilde{p}_i \quad (22)$$

بعد از این گروه بندی، قسمت عدم اطمینان به صورت زیر بازنویسی می شود:

$$\sum_m a_{im} x_m + \sum_k b_{ik} y_k + \left\{ -\xi_{i0} \hat{p}_i + \sum_{m \in M_i} \xi_{im} \hat{a}_{im} x_m + \sum_{k \in K_i} \xi_{ik} \hat{b}_{ik} y_k \right\} \leq p_i \quad (23)$$

با یک مجموعه عدم اطمینان از پیش تعریف شده  $U$  برای متغیرهای تصادفی  $\xi = \{\xi_{i0}, \xi_{im}, \xi_{ik}\}$ ، به دنبال جوابی هستیم که برای هر  $\xi$  در این مجموع موجه باقی بماند تا جواب را در برابر ناموجه بودن ایمن سازیم. یعنی داشته باشیم:

$$\sum_m a_{im} x_m + \sum_k b_{ik} y_k + \max_{\xi \in U} \left\{ -\xi_{i0} \hat{p}_i + \sum_{m \in M_i} \xi_{im} \hat{a}_{im} x_m + \sum_{k \in K_i} \xi_{ik} \hat{b}_{ik} y_k \right\} \leq p_i \quad (24)$$

در نهایت با جایگزین کردن محدودیت اولیه  $\xi$  با محدودیت همتای استوار بالا، همتای استوار مسئله برنامه ریزی عدد صحیح مختلط اولیه به دست می آید:

$$\text{Max} \sum_m c_m x_m + \sum_k d_k y_k \quad (25)$$

$$\text{s.t.} \sum_m a_{im} x_m + \sum_k b_{ik} y_k + \quad (26)$$

$$\text{Max}_{\xi \in U} \left\{ -\xi_{i0} \hat{p}_i + \sum_{m \in M_i} \xi_{im} \hat{a}_{im} x_m + \sum_{k \in K_i} \xi_{ik} \hat{b}_{ik} y_k \right\} \leq p_i \forall i \quad (27)$$

**مثال ۱:** مسئله بهینه سازی خطی عدد صحیح مختلط زیر را در نظر بگیرید:

$$\text{Max } 3x_1 + 2x_2 - 10y_1 - 5y_2$$

$$\text{s.t. } x_1 + x_2 \leq 20$$

$$x_1 + 2x_2 \leq 12$$

$$a_{31}x_1 - b_{31}y_1 \leq 0$$

$$a_{42}x_2 - b_{42}y_2 \leq 0$$

$$x_1 - x_2 \leq -4$$

$$x_1 \geq 0, x_2 \leq 10, y_1, y_2 \in \{0, 1\}$$

فرض کنید ضرایب سمت چپ محدودیت های سوم و چهارم در معرض عدم اطمینان قرار داشته باشند:

$$a_{31} = 1 + 0.1\xi_{31}, \quad b_{31} = -20 + 2\xi_{33}$$

$$a_{41} = 1 + 0.1\xi_{41}, \quad b_{41} = -20 + 2\xi_{44}$$

همتای استوار مسئله بالا را فرموله کنید.

**حل:**

با استفاده از فرموله سازی همتای استوار رابطه (۲۵) و با توجه به نبود نادقیقی در سمت راست محدودیت

ها (یعنی  $\hat{p}_i$ )، همتای استوار محدودیت های سوم و چهارم به صورت زیر نوشته می شود:

$$x_1 - 20y_1 + \text{Max}_{\xi_{31}, \xi_{33} \in U_1} \{0.1\xi_{31}x_1 + 2\xi_{33}y_1\} \leq 0$$

$$x_2 - 20y_2 + \text{Max}_{\xi_{41}, \xi_{44} \in U_2} \{0.1\xi_{41}x_2 + 2\xi_{44}y_2\} \leq 0$$

$U_1$  و  $U_2$  مجموعه های عدم اطمینان از پیش تعریف شده به ترتیب برای  $(\xi_{31}, \xi_{33})$  و  $(\xi_{41}, \xi_{44})$  هستند. فرموله سازی همتای استوار بالا مبتنی بر انتخاب مجموعه های عدم اطمینان  $U$  هستند. در ادامه، چندین مجموعه عدم اطمینان مختلف بررسی، سپس فرموله سازی همتای استوار آن ها توضیح داده می شود.

### مجموعه های عدم اطمینان

#### مجموعه عدم اطمینان جعبه ای

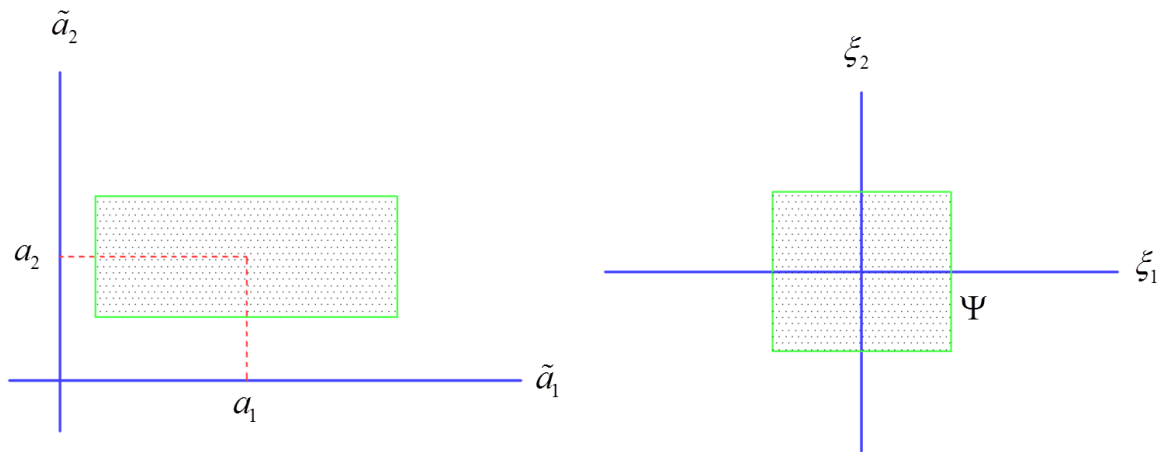
مجموعه عدم اطمینان جعبه ای با استفاده از نرم<sup>۱۴</sup> بی نهایت بردار داده عدم اطمینان به صورت زیر بیان می شود:

$$U_{\infty} = \{ \xi \mid \|\xi\|_{\infty} \leq \Psi \} = \{ \xi \mid \xi_j \leq \Psi, \forall j \in J_i \} \quad (28)$$

$\Psi$  پارامتر قابل تنظیم است که اندازه مجموعه عدم اطمینان را کنترل می کند.

اگر پارامترهای عدم اطمینان در فواصل معین  $\tilde{a}_{ij} \in [a_{ij} - \hat{a}_{ij}, a_{ij} + \hat{a}_{ij}] \forall j \in J_i$  محدود شده باشد، سپس عدم اطمینان به صورت  $\tilde{a}_{ij} = a_{ij} + \xi_{ij} \hat{a}_{ij}$  نشان داده می شود، به طوری که  $\xi_{ij}$  در بازه  $[-1, 1]$  توزیع می شود. وقتی  $\Psi = 1$  (یعنی  $U_{\infty} = \{ \xi \mid \|\xi_j\| \leq 1, \forall j \in J_i \}$ ) باشد، مجموعه عدم اطمینان فاصله ای را خواهیم داشت که یک مورد خاص از مجموعه عدم اطمینان جعبه ای است. شکل زیر این نوع مجموعه عدم اطمینان را نشان می دهد.

<sup>۱۴</sup> Norm



شکل ۱ - نمایش عدم اطمینان جعبه ای

**توجه:** برای مطالعه ادامه این درس شامل انواع مجموعه های غیرقطعی، مدل سازی همتای استوار مجموعه های غیرقطعی، رویکردهای استوار سویستر، بن تال و نیمروفسکی، و برتسیماس و سیم، و حل مثال های عددی با توضیح کامل، جزوه آموزشی این درس را از وب سایت گروه بهینه یاب به نشانی [www.behinehyab.com](http://www.behinehyab.com) تهیه نمایید.

برای دریافت بسته‌های آموزشی گروه **بهینه‌یاب** به وب سایت ما به نشانی

[www.behinehyab.com](http://www.behinehyab.com) مراجعه کنید.

در صورت هر گونه سوال از طریق ایمیل به نشانی [behinehyab@gmail.com](mailto:behinehyab@gmail.com) و یا

بخش "تماس با ما" وب سایت گروه **بهینه‌یاب** با ما در تماس باشید.

با تشکر از توجه شما

گروه آموزشی **بهینه‌یاب**