

Преподаватель: Власов Павел Александрович (ищи его в 1025л)

E-mail: pvlx@mail.ru

Лабораторныеработы: Пн, 19:10

Лекция 1

7 сентября 2015

1 Задачи методов оптимизации

1.1 Классификация задач оптимизации

Задача оптимизации имеет обычно имеет следующий вид:

$$\begin{cases} f(x) \rightarrow extr \\ x \in G \end{cases},$$

здесь f называется целевой функцией или критерием оптимальности, G называется множеством допустимых решений.

Замечание:

1. Задача min-целевой функции одной переменной:

$$\begin{cases} f(x) \rightarrow min \\ x \in [a, b] \subseteq \mathbb{R} \end{cases}$$

2. Задача безусловной оптимизации функции нескольких переменных:

$$\begin{cases} f(x) \rightarrow min \\ x \in G \subseteq \mathbb{R}^n \end{cases}$$

3. Задача условной оптимизации функции нескольких переменных:

$$\begin{cases} f(x) \rightarrow min \\ \phi(x) = 0 \\ x \in G \subseteq \mathbb{R}^n \end{cases}$$

1. Если $f : G \rightarrow \mathbb{R}$ - скалярная функция, то соответствующая задача называется задачей математическим программированием
2. Если $f : G \rightarrow \mathbb{R}^m, m \geq 2$, то соответствующая задача называется задачей многокритериальной оптимизации

Для задач математического программирования дальнейшая классификация:

Вид функции	Стр. множества G	Название задачи
Линейная	Выпуклый многоугольник в \mathbb{R}^n	Задача линейного программирования
Квадратичная	Выпуклый многоугольник в \mathbb{R}^n	Задача квадратичного программирования
Выпуклая	Выпуклое множество в \mathbb{R}^n	Задача выпуклого программирования
Произвольная	Конечное множество	Задача дискретного программирования
Произвольная	Подмножество множества \mathbb{Z}^n	Задача целочисленного программирования
Произвольная	Подмножество в $\{0, 1\}^n$	Задача логического программирования

Замечание:

1. В этом семестре будем заниматься задачами линейного и целочисленного программирования. Задачами выпуклого и квадратичного программирования будем заниматься в следующем семестре.
2. Как правило задачи оптимизации, в которых мн-во G конечно или счетно, относят к разделу методов оптимизации, которые называется *исследованием операций*.

1.2 Венгерский метод решения задач о назначениях

1.2.1 Постановка задачи о назначениях

Содержательная постановка.

В распоряжении работодателя имеется n работ и n исполнителей. Стоимость выполнения i -ой работы j -ым исполнителем составляет $c_{ij} \geq 0$ единиц. Необходимо распределить все работы между исполнителями таким образом, чтобы:

1. Каждый исполнитель исполнял ровно одну работу
2. Суммарная стоимость выполнения всех работ была бы минимальной

Введем управляемые переменные:

$$x_{ij} = \begin{cases} 1, & \text{если } i\text{-ую работу исполняет } j\text{-ый исполнитель} \\ 0, & \text{иначе} \end{cases}$$

Замечание:

Переменную x_{ij} , $i, j = \overline{1, n}$, удобно записывать в матрицу:

$$x = \begin{bmatrix} x_{11} & \dots & x_{1n} \\ \vdots & & \vdots \\ x_{n1} & \dots & x_{nn} \end{bmatrix},$$

которая называется матрицей назначений.

Стоимости c_{ij} записывают в матрицу,

$$C = \begin{bmatrix} C_{11} & \dots & C_{1n} \\ \vdots & & \vdots \\ C_{n1} & \dots & C_{nn} \end{bmatrix},$$

которая называется матрицей стоимостей.

Тогда целевая функция

$$f(x) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n c_{ij} x_{ij}$$

$$\sum_{i=1}^n x_{ij} = 1$$

Условие того, что j -ый исполнитель выполняет ровно одну работу

$$\sum_{j=1}^n x_{ij} = 1$$

Условие того, что i -ую работу выполняет ровно один исполнитель

Математическая постановка задачи о назначении:

$$\begin{cases} f(x) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n c_{ij} x_{ij} \rightarrow \min \\ \sum_{i=1}^n x_{ij} = 1, & j = \overline{1, n} \\ \sum_{j=1}^n x_{ij} = 1, & i = \overline{1, n} \\ x_{ij} \in \{0, 1\}, & i, j = \overline{1, n} \end{cases}$$

Замечание:

Множество допустимых решений задачи о назначении является конечным и состоит из $n!$ элементов. Одним из возможных методов решения этой задачи является прямой перебор допустимых решений однако при больших n он практически не реализуем ввиду большой сложности.

1.2.2 Предварительные соображение о методе решений задачи о назначении:

Соображение 1

Выполним над элементами матрицы стоимостей C следующие преобразования:

1. Из всех элементов j -ого столбца вычтем некоторое число α_j , $j = \overline{1, n}$
2. Из всех элементов i -ой строки вычтем некоторое число β_i , $i = \overline{1, n}$

Обозначим полученную матрицу \tilde{C}

$$f_{\tilde{C}}(x) = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n \tilde{c}_{ij} x_{ij} = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n (c_{ij} - \alpha_j - \beta_i) x_{ij} = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n c_{ij} x_{ij} - \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n \alpha_j x_{ij} - \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n \beta_i x_{ij} = f_c(x) - \gamma$$
$$\gamma = - \sum_{j=1}^n \alpha_j - \sum_{i=1}^n \beta_i$$

В результате:

$$f_{\tilde{C}}(x) = f_c(x) + const$$

То есть задачи о назначениях с матрицей C и с матрицей \tilde{C} эквивалентно (то есть оптимальные значение функций f_c и $f_{\tilde{C}}$ достигаются при одном и том же x_{ij}).

Соображение 2

Предположим, что в матрице C нашлись n нулей, никакие два из которых не стоят на одной строке и одном столбце.

В этом случае можно сразу записать решение рассматриваемой задачи в матрице x , ставим единицы в тех позициях, в которых в матрице C стоят нули. Остальные элементы матрицы x полагаем равными 0.

$$f(x) = \sum_{i,j} c_{ij} x_{ij} \geq 0$$

$$f(x_{opt}) = 0$$

Определение: Набор нулей матрицы C будем называть *системой независимых нулей* (СНН), если никакие 2 нуля этой системы не стоят в одной строке и одном столбце

Замечание: Для решения задачи о назначениях достаточно преобразовать матрицу C к эквивалентному виду, в котором будет содержаться система из n независимых 0.

Замечание: “Слабые места”

1. Возможно после выполнения указанных преобразований мы получим матрицу, из нулей которой в принципе невозможно сформировать систему независимых нулей.

$$\begin{bmatrix} 3 & 1 & 5 & 7 \\ 1 & 1 & 3 & 4 \\ 6 & 1 & 5 & 5 \\ 7 & 1 & 9 & 8 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 2 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ 5 & 0 & 2 & 1 \\ 6 & 0 & 6 & 4 \end{bmatrix}$$

В этой матрице максимальное число в системе независимых нулей равно 2

2. Возможно в некоторой текущей матрице стоимостей существует набор независимых нулей. Но его построение затруднительно.

В любом из этих случаев построенная система независимых нулей (в которой меньше чем n нулей) может быть улучшена.

Будем считать, что после вычитания наименьших элементов из строк и столбцов матрицы C первоначальная система независимых нулей строится по следующему правилу: просматриваем элементы матрицы C по столбцам в поисках нулей. Если в одном столбце и одной строке с найденным нулем не стоит 0^* , то отмечаем найденные нули звездочкой.

1.2.3 1-ый способ улучшения текущей СНН

Идея: убрать из СНН несколько нулей так, чтобы добавить большее число нулей.

Отметим «+» столбцы, в которых стоят 0^* . Эти столбцы и их элементы будем называть *выделенными*.

Если среди невыделенных элементов есть 0, то можно попытаться улучшить текущую СНН, включив в нее этот 0. Отметим этот 0 штрихом.

В этом случае строка, в которой располагается этот 0, уже не может содержать других элементов СНН. Поэтому если в одной строке с $0'$ есть 0^* , то необходимо снять выделение со столбца, в котором стоит 0^* и выделить строку, в которой стоит $0'$.

Снова среди невыделенных элементов ищем 0 и отмечаем его штрихом. В одной строке с этим $0'$ нет 0^* . Это значит, что можно построить L-цепочку:

от текущего $0' \rightarrow_{\text{по столбцу}} 0^* \rightarrow_{\text{по строке}} 0' \rightarrow 0^* \rightarrow \dots \rightarrow 0'$

L-цепочка должна быть непродолжаемой и начинаться и заканчиваться $0'$.

В пределах этой L-цепочки 0^* заменяем на просто 0, а $0'$ на 0^* .

Лекция 2

14 сентября 2015

Слабое место 1

В текущей матрице C не существуют СНН из n нулей тогда и только тогда, когда среди невыделенных элементов нет 0.

$$C = \begin{bmatrix} 0^{*+} & 0 & 1 & 4 \\ 1 & 2 & 0^{*+} & 1 \\ 2 & 2 & 5 & 0^{*+} \\ 3 & 1 & 0 & 5 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 0^* & 0' & 1 & 4 \\ 1 & 2 & 0^* & 1 \\ 2 & 2 & 5 & 0^* \\ 3 & 1 & 0 & 5 \end{bmatrix} \rightarrow$$

Выберем среди невыделенных элементов наименьший элемент $h > 0$. В этом примере $h = 1$. Вычтем его из невыделенных столбцов

$$\rightarrow \begin{bmatrix} -1^* & -1 & 1 & 4 \\ 0 & 1 & 0^* & 1 \\ 1 & 1 & 5 & 0^* \\ 2 & 0 & 0 & 5 \end{bmatrix} \rightarrow$$

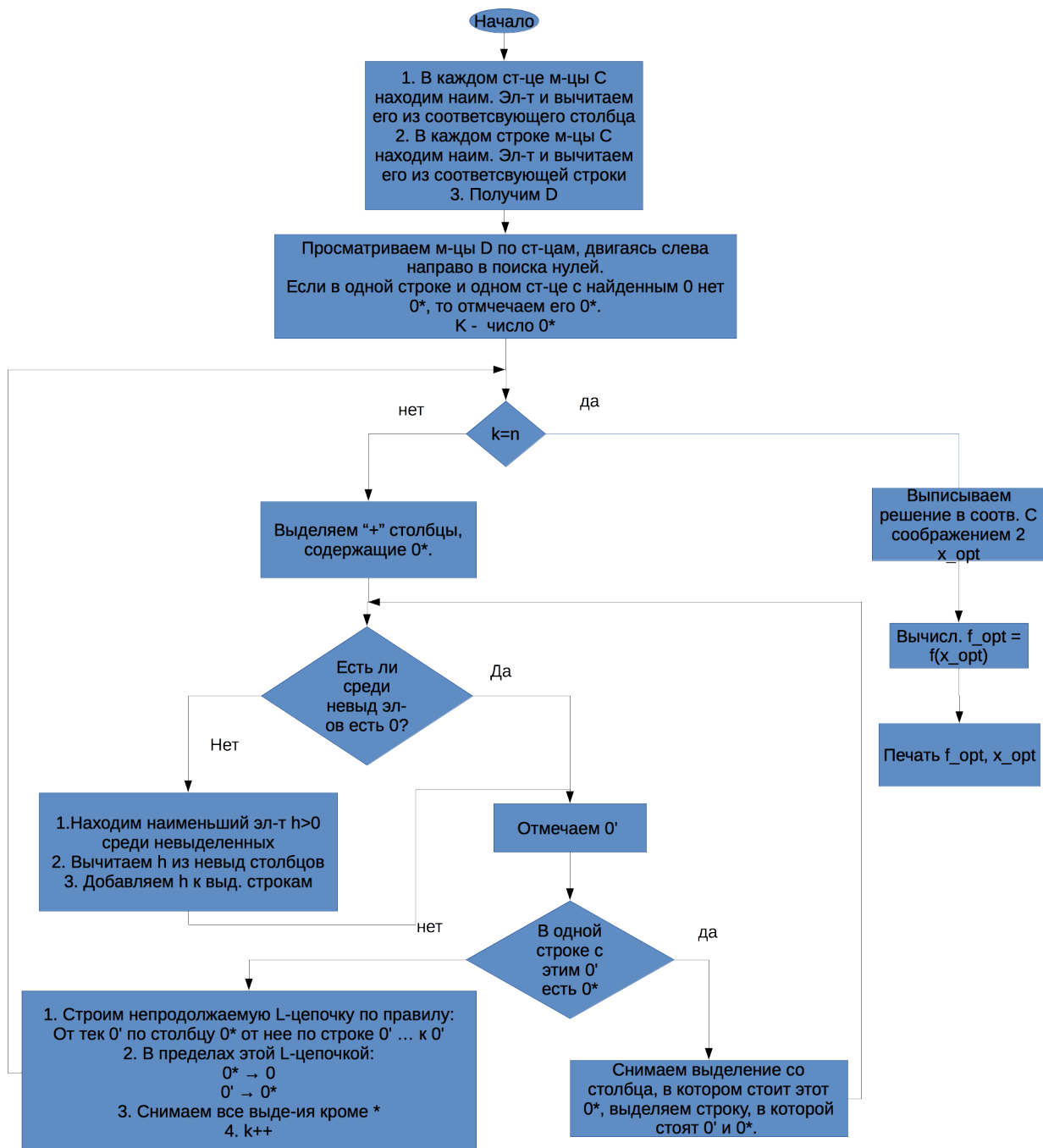
Наличие отрицательных значений не позволяет использовать пункт 2. Прибавим h к выделенным строкам:

$$\rightarrow \begin{bmatrix} 0^* & 0' & 2 & 5 \\ 0 & 1 & 0^* & 1 \\ 1 & 1 & 5 & 0^* \\ 2 & 0 & 0 & 5 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 0^* & 0' & 2 & 5 \\ 0' & 1 & 0^* & 1 \\ 1 & 1 & 5 & 0^* \\ 2 & 0 & 0 & 5 \end{bmatrix} \rightarrow$$

В одной строке с нулем нет 0^* . Строим L-цепочку.

$$\rightarrow \begin{bmatrix} 0 & 0^* & 2 & 5 \\ 0^* & 1 & 0 & 1 \\ 1 & 1 & 5 & 0^* \\ 2 & 0 & 0^* & 5 \end{bmatrix} \Rightarrow x_{opt} = \begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \end{bmatrix}$$

1.3 Венгерский метод решения задачи о назначениях



Пример:

$$C = \begin{bmatrix} 7 & 2 & 8 & 2 & 5 \\ 1 & 2 & 3 & 1 & 2 \\ 7 & 2 & 5 & 3 & 6 \\ 6 & 2 & 12 & 3 & 6 \\ 4 & 7 & 11 & 1 & 9 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 6 & 0 & 5 & 1 & 3 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 6 & 0 & 2 & 2 & 4 \\ 5 & 0 & 9 & 2 & 4 \\ 3 & 5 & 8 & 0 & 7 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 6 & 0^* & 5 & 1 & 3 \\ 0^* & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 6 & 0 & 2 & 2 & 4 \\ 5 & 0 & 9 & 2 & 4 \\ 3 & 5 & 8 & 0^* & 7 \end{bmatrix} \rightarrow k = 3 < 5 = h \rightarrow$$

$$\rightarrow \begin{bmatrix} 6 & 0^* & 5 & 1 & 3 \\ 0^* & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 6 & 0 & 2 & 2 & 4 \\ 5 & 0 & 9 & 2 & 4 \\ 3 & 5 & 8 & 0^* & 7 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 6 & 0^* & 5 & 1 & 3 \\ 0^* & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 6 & 0 & 2 & 2 & 4 \\ 5 & 0 & 9 & 2 & 4 \\ 3 & 5 & 8 & 0^* & 7 \end{bmatrix} \rightarrow$$

Среди невыделенных элементов нет 0 тогда $h = 2$

$$\rightarrow \begin{bmatrix} 4 & 0^* & 3 & 1 & 1 \\ 0^* & 2 & 0' & 2 & 0 \\ 4 & 0 & 0' & 2 & 2 \\ 3 & 0 & 7 & 2 & 2 \\ 1 & 5 & 6 & 0^* & 5 \end{bmatrix} \rightarrow \text{Делаем L-цепочку} \rightarrow \begin{bmatrix} 4 & 0^* & 3 & 1 & 1 \\ 0^* & 2 & 0 & 2 & 0 \\ 4 & 0 & 0' & 2 & 2 \\ 3 & 0 & 7 & 2 & 2 \\ 1 & 5 & 6 & 0^* & 5 \end{bmatrix} \rightarrow k = 4 \rightarrow$$

$$\rightarrow \begin{bmatrix} 4 & 0^* & 3 & 1 & 1 \\ 0^* & 2 & 0 & 2 & 0' \\ 4 & 0 & 0' & 2 & 2 \\ 3 & 0 & 7 & 2 & 2 \\ 1 & 5 & 6 & 0^* & 5 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 4 & 0^* & 3 & 1 & 1 \\ 0^* & 2 & 0 & 2 & 0 \\ 4 & 0 & 0' & 2 & 2 \\ 3 & 0 & 7 & 2 & 2 \\ 1 & 5 & 6 & 0^* & 5 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 4 & 0^* & 3 & 1 & 1 \\ 0^* & 2 & 0 & 2 & 0' \\ 4 & 0 & 0' & 2 & 2 \\ 3 & 0 & 7 & 2 & 2 \\ 1 & 5 & 6 & 0^* & 5 \end{bmatrix} \rightarrow k = 1 \rightarrow$$

$$\rightarrow \begin{bmatrix} 3 & 0^* & 3 & 1 & 0' \\ 0^* & 3 & 1 & 3 & 0' \\ 3 & 0 & 0' & 2 & 1 \\ 2 & 0 & 7 & 2 & 1 \\ 0 & 5 & 6 & 0^* & 4 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 3 & 0^* & 3 & 1 & 0' \\ 0^* & 3 & 1 & 3 & 0' \\ 3 & 0 & 0' & 2 & 1 \\ 2 & 0 & 7 & 2 & 1 \\ 0 & 5 & 6 & 0^* & 4 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 3 & 0^* & 3 & 1 & 0' \\ 0^* & 3 & 1 & 3 & 0' \\ 3 & 0 & 0^* & 2 & 1 \\ 2 & 0 & 7 & 2 & 1 \\ 0' & 5 & 6 & 0^* & 4 \end{bmatrix} \rightarrow$$

$$\rightarrow \begin{bmatrix} 3 & 0^* & 3 & 1 & 0' \\ 0^* & 3 & 1 & 3 & 0' \\ 3 & 0' & 0^* & 2 & 1 \\ 2 & 0 & 7 & 2 & 1 \\ 0' & 5 & 6 & 0^* & 4 \end{bmatrix} \rightarrow \text{Строим L-цепочку} \rightarrow \begin{bmatrix} 3 & 0 & 3 & 1 & 0^* \\ 0^* & 3 & 1 & 3 & 0 \\ 3 & 0 & 0^* & 3 & 1 \\ 2 & 0^* & 7 & 2 & 1 \\ 0 & 5 & 6 & 0^* & 4 \end{bmatrix} \Rightarrow$$

$$\Rightarrow x_{opt} = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{bmatrix}$$

$$f_{opt} = 5 + 1 + 5 + 2 + 1 = 14$$

Замечание:

1. Встречается среди задач о назначениях, в которых величины c_{ij} интерпретируются как прибыль от выполнения i -ой работы j -ым работником. В этом случае задача о назначениях является задачей максимизации:

$$\begin{cases} f = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n c_{ij} x_{ij} \rightarrow \max \\ \text{те же ограничения} \end{cases} \quad (1)$$

2. В этом случае исходной задаче (1) будет эквивалентна задача:

$$\begin{cases} f_l = f = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n (-c_{ij}) x_{ij} \rightarrow \min \\ \text{те же ограничения} \end{cases} \quad (2)$$

которая не может быть решена с использованием венгерского метода ввиду неположительных $-c_{ij}$.

3. Выберем среди c_{ij} наиб. элементы a и прибавим его всем элементам m -це ($-c$):

$$-\tilde{c}_{ij} = a - c_{ij}$$

Тогда задача

$$\begin{cases} f = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n \tilde{c}_{ij} x_{ij} \rightarrow \min \\ \text{те же ограничения} \end{cases}$$

эквивалентна задаче (2) и очевидно задаче (1) и может быть решена венгерским методом.

2 Линейное программирование

Задача:

$$\begin{cases} f = \sum_{j=1}^n c_j x_j \rightarrow \text{extr} \\ \sum_{j=1}^n a_{ij} x_j \{ \geq / < / = \} b_i \quad i = \overline{1; m} \end{cases}$$

2.1 Основные определения

2.1.1 Задача распределительного типа

Задача распределительного типа является характерной задачей линейного программирования

Пример: Кондитерская фабрика выпускает 2 вида карамели (обозначим их А и Б), да производства которых используются сахарный песок и фруктовое пюре. Данные о затратах:

	Нормы затрат		Общий объем запасов (т)
	А	Б	
Сахарный песок	1	3	13
Фруктовое пюре	3	2	18
Стоимость изготовления 1т. готового продукта	1	2	

Кроме того известно, что рыночный спрос на карамель Б-вида не превышает 4т.

Составить оптимальный план производства, максимизирующий доходы от продаж.

Введем управляемые переменные:

x_1 - объем производства карамели А (т)

x_2 - объем производства карамели Б (т)

Тогда:

1. Доход от продажи:

$$f = 1 \cdot x_1 + 2 \cdot x_2$$

2. Ограничение на запасы:

(а) песка:

$$1 \cdot x_1 + 3 \cdot x_2 \leq 13$$

(b) пюре:

$$3 \cdot x_1 + 2 \cdot x_2 \leq 18$$

(с) ограничение на рыночный спрос:

$$x_2 \leq 4$$

Математическая модель:

$$\begin{cases} f = 1 \cdot x_1 + 2 \cdot x_2 \\ 1 \cdot x_1 + 3 \cdot x_2 \leq 13 \\ 3 \cdot x_1 + 2 \cdot x_2 \leq 18 \\ x_2 \leq 4 \\ x_1 \geq 0, x_2 \geq 0 \end{cases}$$

Лекция 3

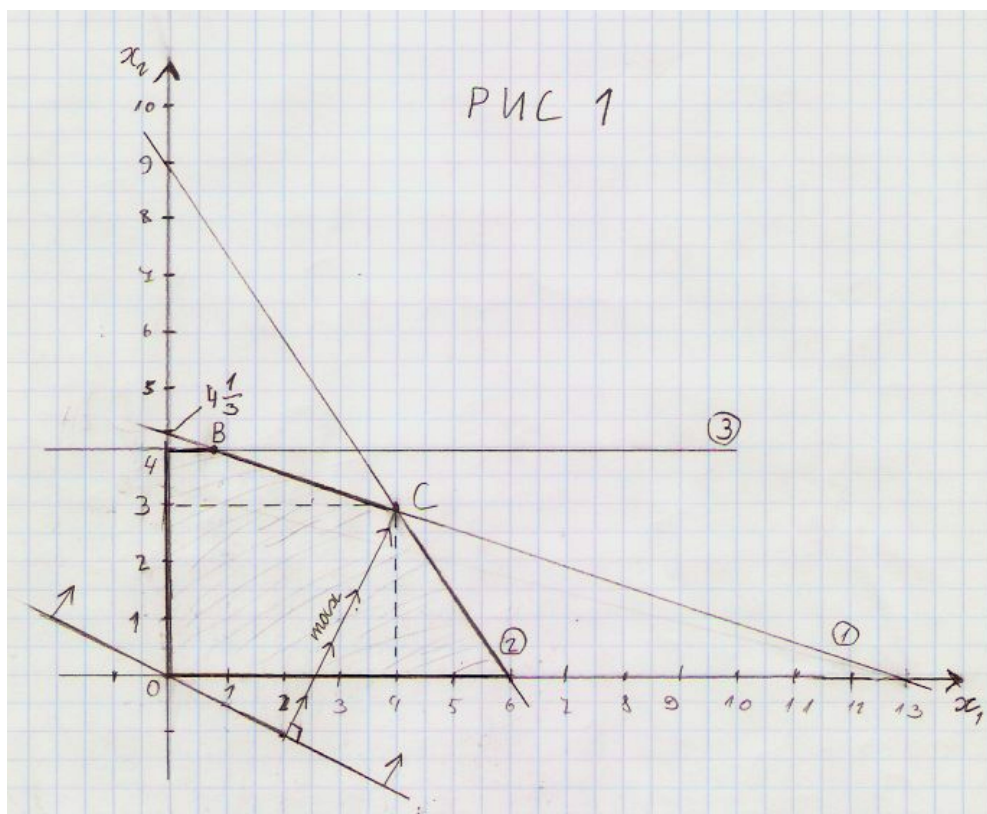
21 сентября 2015

2.2 Графический метод

Графический метод может быть использован для решения ЗЛП малой размерности ($n \leq 2$)

Пример: Рассмотрим задачу о производстве карамели

$$f = x_1 + 2 \cdot x_2 = 0$$



Градиент функции

$$\text{grad} f = \frac{\partial f}{\partial x_1} \vec{i} + \frac{\partial f}{\partial x_2} \vec{j} = \vec{i} + 2 \cdot \vec{j}$$

Нужно решить систему:

$$C = (1) \cap (2) \Rightarrow \begin{cases} x_1 + 3x_2 = 13 \\ 3x_1 + 2x_2 = 18 \end{cases} \Rightarrow x_1 = 4; x_2 = 3$$

Замечание: На примере этой задачи можно уловить некоторые особенности присущие всем задача линейного программирования.

1. Множество допустимых решений является выпуклым.
2. Оптимальное значение целевой функции достигается в крайней точке множества допустимых решений
3. Если оптимальное значение целевой функции достигается в двух различных точках p, q , то оно достигается во всех точках отрезка $[p, q]$.

2.3 Стандартная форма ЗЛП

Общая форма ЗЛП:

$$\begin{cases} f = \sum_{j=1}^n c_j x_j \rightarrow \text{extr} \\ \sum_{j=1}^n a_{ij} x_j \{ \geq / \leq / = \} b_i \quad i = \overline{1; m} \end{cases}$$

Определение: Стандартной формой ЗЛП называется задача следующего вида:

$$\begin{cases} f = \sum_{j=1}^n c_j x_j \rightarrow \max \\ \sum_{j=1}^n a_{i,j} x_j = b_i \\ x_j \geq 0, \quad j = \overline{1, n} \end{cases}$$

где $b_i \geq 0, i = \overline{1, m}$.

Признаки стандартной формы

1. Целевая функция максимизируется
2. Все ограничения имеют вид неравенств с положительными правыми частями
3. Все переменные больше 0

Любая ЗЛП может быть приведена к стандартной форме:

1. Если $f \rightarrow \min$ то рассм задачу с функцией

$$f_1 = -f = \sum_{j=1}^n (-c_j x_j) \rightarrow \max$$

2. Если некоторое ограничения имеет вид

$$\sum_{j=1}^n b_{i,j} x_j = b_{i,j},$$

где $b_i < 0$, то умножим обе его части на (-1) :

$$\sum_{j=1}^n (-b_{i,j}) x_j = -b_{i,j}$$

3. Если некоторое ограничение имеет вид неравенства:

$$\sum_{j=1}^n a_{i,j} x_j \leq b_i,$$

то введем дополнительную переменную $x_{n+1} \geq 0$

$$\sum_{j=1}^n a_{i,j} x_j + x_{n+1} = b_i$$

4. Если некоторое ограничение имеет вид неравенства:

$$\sum_{j=1}^n a_{i,j} x_j \geq b_i,$$

то введем дополнительную переменную $x_{n+1} \geq 0$:

$$\sum_{j=1}^n a_{i,j} x_j - x_{n+1} = b_i$$

5. Если некоторая переменная x_j подчинена условию неположительности то есть $x \leq 0$, то рассмотрим вместо нее переменную $-x_j$
6. Если некоторая переменная x_j не подчинена ни условию $x_j \geq 0$ ни условию $x_j \leq 0$ то не ограничена в знаке то представим ее в виде разности:

$$\begin{aligned} x_j &= x'_j - x''_j, \\ x'_j &\geq 0 \\ x''_j &\geq 0 \end{aligned}$$

Пример:

$$\begin{cases} f = x_1 + 2x_2 - 3x_3 \rightarrow \min \\ 2x_1 + x_2 - x_3 \geq -3 \\ x_1 - x_2 + x_3 \geq 4 \\ x_1 - 2x_2 + 5x_3 = -1 \\ x_1 \geq 0 \\ x_2 \leq 0 \\ x_3 \text{ не ограничена в знаке} \end{cases}$$

$$\begin{cases} f = -x_1 - 2x_2 + 3x_3 \rightarrow \min \\ 2x_1 + x_2 - x_3 - x_4 = -3 \\ x_1 - x_2 + x_3 - x_5 = 4 \\ -x_1 + 2x_2 - 5x_3 = -1 \\ x_1 \geq 0 \\ x_2 \geq 0 \quad (x'_2 = -x_2) \\ x_3 = x'_3 - x''_3 \quad (x'_3 \geq 0, x''_3 \geq 0) \\ x_4 \geq 0 \\ x_5 \geq 0 \end{cases}$$

$$\begin{cases} f = -x_1 + 2x'_2 + 3x'_3 - 3x''_3 \rightarrow \min \\ -2x_1 + x'_2 + x'_3 - x''_3 + x_4 = 3 \\ x_1 - x'_2 + x'_3 - x''_3 - x_5 = 4 \\ -x_1 + 2x_2 - 5x_3 = -1 \\ x_1 \geq 0 \\ x'_2 \geq 0, (x'_2 = -x_2) \\ x'_3 \geq 0, x''_3 \geq 0 \\ x_4 \geq 0, x_5 \geq 0 \\ ? \end{cases}$$

Рассмотрим ЗЛП в ст. р

$$\begin{cases} f = \sum_{j=1}^n c_j x_j \rightarrow \max \\ \sum_{j=1}^n a_{i,j} x_j = b_i, i = \overline{1, m} \\ x_j \geq 0, j = \overline{1, n} \end{cases}$$

Введем обозначения:

$$A = (a_{i,j})_{i=\overline{1;m}}$$

$$b = \begin{pmatrix} b_1 \\ \vdots \\ b_m \end{pmatrix}$$

$$x = \begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix}$$

$$C = \begin{pmatrix} C_1 \\ \vdots \\ C_n \end{pmatrix}$$

$$\begin{cases} f = c^T x \rightarrow \max \\ Ax = b \geq 0 \\ x \geq 0 \end{cases}$$

Замечание: Всюду в дальнейшем будем предполагать, что

1. Ранг матрицы $A = \text{rg}(A|b)$ - по теореме Кронекера-Капелли. Если условие не выполняется, то СЛАУ $Ax = b$ не совместна, а это значит, что множество дополнительных решений пусто.
2. $\text{rg}(A|b) = m$, где m -число ограничений. m -число строк в $(A|b) \Rightarrow \text{rg}(A|b) \leq m$. Если $\text{rg}(A|b) < m$, то система ограничений является линейнозависимой то есть некоторые ограничения можно убрать не изменив множество допустимых решений
3. $m < n$, где n - число переменных. Если $m > n$, то $\text{rg}(A|b) > n$ - число столбцов. Если $m = n$ в силу пунктов 1 и 2 СЛАУ $Ax = b$ имеет единственное решение, следовательно задачи оптимизации вырождения.

2.4 О применимости графического метода

Графический метод может быть применен в случае, когда $n \leq 2$. Иногда его можно использовать и в случае $n > 2$.

Рассмотрим ЗЛП в стандартной форме:

$$\begin{cases} f = c^T x \rightarrow \max \\ Ax = b \geq 0 \\ x \geq 0 \end{cases}$$

Если $m - n \leq 2$, то можно использовать графический метод.

Пример:

$$\begin{cases} f = x_1 - 2x_2 + x_3 \rightarrow \max \\ x_1 + x_2 + x_3 + x_4 = 1 \\ x_1 + 2x_2 - x_3 - x_5 = 2 \\ -x_1 + x_2 + x_3 = 3 \\ x_1, \dots, x_5 \geq 0 \end{cases}$$

$$(A|b) = \left[\begin{array}{ccccc|c} 1 & 1 & 1 & 1 & 0 & 1 \\ 1 & 2 & -1 & 0 & -1 & 2 \\ -1 & 1 & -4 & 0 & 0 & 3 \end{array} \right] \sim$$

Если $\text{rg}(A|b) = 3$, то $h - m = 2$, тогда можно использовать

$$\sim \left[\begin{array}{ccccc|c} 1 & 1 & 1 & 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & -2 & -1 & -1 & 1 \\ 0 & 2 & 3 & 1 & 0 & 4 \end{array} \right] \sim \left[\begin{array}{ccccc|c} 1 & 1 & 1 & 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & -2 & -1 & -1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 3 & 2 & 2 \end{array} \right] \sim$$

$$\text{rg}(A|b) = 3$$

$$\sim \left[\begin{array}{ccccc|c} 1 & 1 & 1 & 0 & -2 & -1 \\ 0 & 1 & 0 & 5 & 3 & 5 \\ 0 & 0 & 1 & 3 & 2 & 2 \end{array} \right] \sim \left[\begin{array}{ccccc|c} 1 & 0 & 0 & -7 & -5 & -6 \\ 0 & 1 & 0 & 5 & 3 & 5 \\ 0 & 0 & 1 & 3 & 2 & 2 \end{array} \right]$$

$$\begin{cases} x_1 = -6 + 7x_4 + 5x_5 \geq 0 \\ x_2 = 5 - 5x_4 - 3x_5 \geq 0 \\ x_3 = 2 - 3x_4 - 2x_5 \geq 0 \end{cases}$$

Подставим в выражение для f :

$$\begin{cases} f = 14x_4 + 2x_5 - 14 \\ 7x_4 + 5x_5 \geq 6 \\ 3x_4 + 5x_5 \leq 2 \\ x_4 \geq 0, x_5 \geq 0 \\ 3x_4 + 2x_5 \leq 2 \end{cases}$$

3 Основные утверждения линейного программирования

3.1 Выпуклые множества

Пусть $x, y \in \mathbb{R}^n$

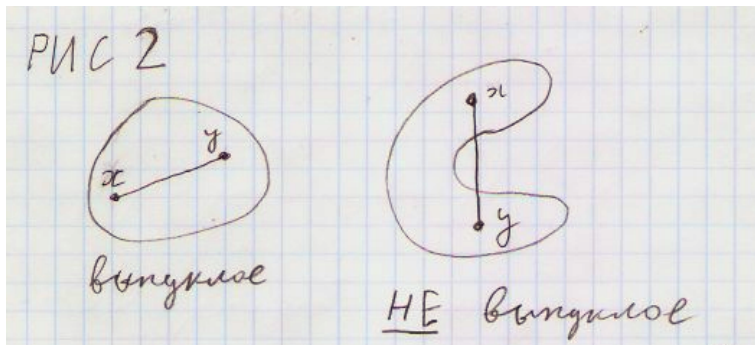
Определение: Отрезком соединяющим точки x и y называется множество точек:

$$t(\lambda) = \lambda x + (1 - \lambda)y, \quad \lambda \in [0; 1]$$

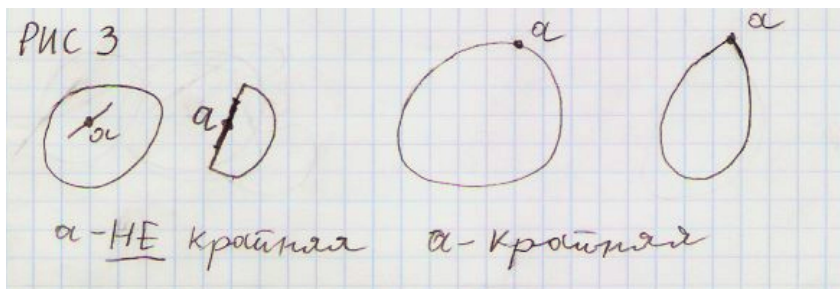
Замечание:

$$\begin{aligned} \lambda = 0 &\Rightarrow t(0) = y \\ \lambda = 1 &\Rightarrow t(1) = x \end{aligned}$$

Определение: Множество $G \in \mathbb{R}^n$ называется выпуклым, если $\forall x, y \in G : xy \subseteq G$



Определение: Точка $a \in G$ выпуклого множества G называется крайней точкой этого множества, если a не содержится строго внутри никакого отрезка целиком лежащего в G .



Определение: Выпуклой комбинацией точек $q_1, \dots, q_k \in \mathbb{R}^n$ называется множество точек:

$$\langle q_1, \dots, q_k \rangle = \left\{ t \in \mathbb{R}^n : t = \lambda_1 q_1 + \dots + \lambda_k q_k, \sum_{j=1}^k \lambda_j = 1, \lambda_j \geq 0 \right\}$$

где

Замечание:

1. Очевидно отрезок

$$xy = \langle x, y \rangle$$

2. Можно доказать что $\langle q_1, \dots, q_k \rangle$ является наименьшим выпуклым множеством содержащим q_1, \dots, q_k

Теорема: Пусть

1. G — выпукло
2. G — ограничено
3. G имеет конечное число крайних точек q_1, \dots, q_k

Тогда $G = \langle q_1, \dots, q_k \rangle$

Конец теоремы

Лекция 4

28 сентября 2015

3.2 Базисные допустимые решения

Рассмотрим ЗЛП в стандартной форме:

$$\begin{cases} f(x) \rightarrow \max \\ Ax = b \\ x \geq 0, \end{cases},$$

где $b \geq 0$, $\text{rg} A = \text{rg}(a|B) = m < n$. m — число ограничений, n — число переменных.

Рассмотрим СЛАУ $Ax = b$.

Будем считать, что m первых столбцов матрицы A ЛНЗ, тогда их можно взять в качестве базисных.

$$A = [a_1 \ a_2 \ \dots \ a_m \ a_{m+1} \ \dots \ a_n],$$

$$A_b = [a_1 \ a_2 \ \dots \ a_m]$$

$$A_{nb} = [a_{m+1} \dots a_n]$$

a_j — j -ый столбец матрицы A .

$$x = \begin{bmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_m \\ x_{m+1} \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix} \quad x_b = \begin{bmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_m \end{bmatrix} \quad x_{nb} = \begin{bmatrix} x_{m+1} \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix}$$

Тогда СЛАУ $Ax = b$ можно записать:

$$A_b x_b + A_{nb} x_{nb} = b \quad (3)$$

A_b является невырожденной (то есть $\det A_b \neq 0$) \Rightarrow из (3) $\Rightarrow x_b = A_b^{-1}b - A_b^{-1}A_{nb}x_{nb}$.

Тогда общее решение СЛАУ $Ax = b$ можно записать в виде

$$x = \begin{bmatrix} x_b \\ x_{nb} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} A_b^{-1}b - A_b^{-1}A_{nb}x_{nb} \\ x_{nb} \end{bmatrix}$$

Здесь компоненты вектора могут принимать любые значения; при каждом конкретном наборе значений этих переменных будем получать некоторое частное решение исходной СЛАУ.

Определение: Базисным решением СЛАУ $Ax = b$ называется то ее частное решение, которое отвечает $x_{nb} = 0$.

$$x^0 = \begin{bmatrix} A_b^{-1}b \\ 0 \end{bmatrix}$$

Замечание:

1. Каждые базисные решения (БР) однозначно определяются выбором m базисных столбцов матрицы $A \Rightarrow$ БР будет равно столько, сколькими способами можно выбрать m базисных столбцов в $A \Rightarrow$ базисных решений будет не более чем C_m^n (не меньше так как не обязательно произвольные m столбцов матрицы A будут ЛПЗ).
2. БР не обязательно являются допустимым решением ЗЛП, так как не обязательно удовлетворяет условию $x \geq 0$.

Определение: Базисным дополнительным решением (БДР) называется такое базисное решение x СЛАУ $Ax = b$, которое удовлетворяет $x \geq 0$.

Определение: Базисное решение называется *вырожденным*, если одна или несколько базисных переменных в нем равны 0.

3.3 Основные утверждения линейного программирования

Рассмотрим ЗЛП в стандартной форме:

$$\begin{cases} f(x) \rightarrow \max \\ Ax = b \\ x \geq 0, \end{cases},$$

где $b \geq 0$, $\text{rg} A = \text{rg}(a|B) = m < n$. m — число ограничений, n — число переменных.

Обозначим множество допустимых решений:

$$G = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax = b, x \geq 0\}$$

Теорема 1: Пусть $G \neq \emptyset$. Тогда G содержит по крайней мере одно БАР.

Теорема 2: Множество G доп. решени ЗЛП выпукло .

Доказательство

Пусть $y, z \in G$.

Рассмотрим $t = \lambda y + (1 - \lambda)z$, $\lambda \in [0; 1]$:

1.

$$At = A(\lambda y + (1 - \lambda)z) = \lambda Ay + (1 - \lambda)Az = \lambda b + b - \lambda b = b$$

2.

$$t = \lambda y + (1 - \lambda)z, \lambda \geq 0, y \geq 0, (1 - \lambda) \geq 0, z \geq 0 \Rightarrow t \geq 0$$

3. 1 и 2 $\Rightarrow t \in G$

Конец доказательства

Теорема 3: Пусть y — БАР ЗЛП в стандартной форме, тогда y — крайняя точка множества G

Теорема 4: Пусть y — крайняя точка множества G , тогда y — БДР ЗЛП

Теорема 5: Пусть:

1. f принимает оптимальное значение хотя бы в одной точке множества G , тогда f принимает это значение в одной крайней точке множества G .
2. Если f принимает оптимальное значение в нескольких точках $q_1, \dots, q_l \in G$, то f принимает это значение в любой точке из выпуклой комбинации $\langle q_1, \dots, q_l \rangle$

Замечание: Таким образом решение ЗЛП следует искать среди крайних точек множества G . Поскольку между крайними точками множества G и БДР ЗЛП существует взаимно однозначное соответствие, искать оптимальное решение следует среди БДР системы $Ax = b$. Этих решений конечное число, тогда одним из возможных методов решения ЗЛП является перебор всех БДР.

Однако эту процедуру оптимизирует так называемый симплекс-метод, который основан на идее последовательного перехода от одного БДР к другому, так, чтобы при этом значение целевой функции f улучшалось (не ухудшалось) .

Пример: Рассмотрим задачу о производстве карамели (без ограничения $x_2 \leq 4$):

$$\begin{cases} f = x_1 + 2x_2 \rightarrow \max \\ x_1 + 3x_2 \leq 13 \\ 3x_1 + 2x_2 \leq 18 \\ x_1 \geq 0 \\ x_2 \geq 0 \end{cases}$$

В стандартной форме:

$$\begin{cases} f = x_1 + 2x_2 \rightarrow \max \\ x_1 + 3x_2 + x_3 = 13 \\ 3x_1 + 2x_2 + x_4 = 18 \\ x_1, x_2, x_3, x_4 \geq 0 \end{cases}$$

$$(A|b) = \left[\begin{array}{cccc|c} 1 & 3 & 1 & 0 & 13 \\ 3 & 2 & 0 & 1 & 18 \end{array} \right]$$

Пусть x_1, x_2 - базовые переменные, тогда

$$(A|b) \sim \left[\begin{array}{cccc|c} 1 & 3 & 1 & 0 & 13 \\ 0 & -7 & -3 & 1 & -21 \end{array} \right] \sim \left[\begin{array}{cccc|c} 1 & 0 & -\frac{2}{7} & \frac{3}{7} & 4 \\ 0 & 1 & \frac{3}{7} & -\frac{1}{7} & 3 \end{array} \right]$$

$$\begin{cases} x_1 = 4 + \frac{2}{7}x_3 - \frac{1}{7}x_4 \\ x_2 = 3 - \frac{3}{7}x_3 + \frac{1}{7}x_4 \end{cases}$$

$$\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 4 + \frac{2}{7}x_3 - \frac{1}{7}x_4 \\ 3 - \frac{3}{7}x_3 + \frac{1}{7}x_4 \\ x_3 \\ x_4 \end{bmatrix}$$

Базисное решение: $x_3 = x_4 = 0$

$$x^0 = \begin{bmatrix} 4 \\ 3 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix} \Rightarrow \text{крайняя точка C.}$$

2) Пусть x_1, x_3 - базисные переменные.

Тогда

$$(A|b) \sim \left[\begin{array}{cccc|c} 1 & \frac{2}{3} & 0 & \frac{1}{3} & 6 \\ 0 & \frac{7}{3} & 1 & -\frac{1}{3} & 7 \end{array} \right]$$

$$\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 6 - \frac{2}{3}x_2 - \frac{1}{3}x_4 \\ x_2 \\ 7 - \frac{7}{3}x_2 + \frac{1}{3}x_4 \\ x_4 \end{bmatrix}$$

Базисное решение: $x_2 = x_4 = 0$

$$x^0 = \begin{bmatrix} 6 \\ 9 \\ 7 \\ 0 \end{bmatrix} \Rightarrow \text{крайняя точка D}$$

Номер базисного столбца	Базисные неизвестные	Небазисные неизвестные	Базисное решение	Крайняя точка
1, 2	x_1, x_2	x_3, x_4	$(4, 3, 0, 0)^T$	C
1, 3	x_1, x_3	x_2, x_4	$(6, 0, 7, 0)^T$	D
1, 4	x_1, x_4	x_2, x_3	$(13, 0, 0, -21)^T$ - не являются допустимым	$H \notin G$
2, 3	x_2, x_3	x_1, x_4	$(0, 9, -14, 0)^T$ - не является допустимым	$F \notin G$
2, 4	x_2, x_4	x_1, x_3	$(0, \frac{13}{3}, 0, \frac{28}{3})^T$	E
3, 4	x_3, x_4	x_1, x_2	$(0, 0, 13, 18)^T$	0

4 Симплекс-метод

4.1 Симплекс-метод при известном БДР

Симплекс-метод является универсальным методом решения ЗЛП. В его основе лежит идея последовательного перехода от одного БДР к другому, так, чтобы значение целевой функции улучшалось (не становилось хуже).

Рассмотрим ЗЛП в стандартной форме:

$$\begin{cases} f(x) \rightarrow \max \\ Ax = b \\ x \geq 0, \end{cases},$$

где $b \geq 0$, $\text{rg} A = \text{rg}(a|B) = m < n$. m – число ограничений, n – число переменных.

Предположим m первых столбцов матрицы A ЛНЗ, значит, что

$$A = [a_1 \ a_2 \ \dots \ a_m \ a_{m+1} \ \dots \ a_n] \quad A_b = [a_1 \ a_2 \ \dots \ a_m] \quad A_{nb} = [a_{m+1} \ \dots \ a_n]$$

$$x = \begin{bmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_m \\ x_{m+1} \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix} \quad x_b = \begin{bmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_m \end{bmatrix} \quad x_{nb} = \begin{bmatrix} x_{m+1} \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix}$$

$$c = \begin{bmatrix} c_1 \\ \vdots \\ c_m \\ c_{m+1} \\ \vdots \\ c_n \end{bmatrix} \quad c_b = \begin{bmatrix} c_1 \\ \vdots \\ c_m \end{bmatrix} \quad c_{nb} = \begin{bmatrix} c_{m+1} \\ \vdots \\ c_n \end{bmatrix}$$

Тогда задача ЗЛП примет вид:

$$\begin{cases} f = c_b^T x_b + c_{nb}^T x_{nb} \rightarrow \max \\ A_b x_b + A_{nb} x_{nb} = b \\ x_b \geq 0, x_{nb} \geq 0 \end{cases}$$

Выразим базисные переменные через небазисные:

$$x_b = A_b^{-1} b - A_b^{-1} A_{nb} x_{nb}$$

Подставим в задачу:

$$f = c_b^T A_b^{-1} b - c_b^T A_b^{-1} A_{nb} x_{nb} + c_{nb}^T x_{nb} = c_b^T A_b^{-1} b + (c_{nb}^T - c_b^T A_b^{-1} A_{nb}) x_{nb}$$

Таким образом:

$$\begin{cases} f = c_b^T A_b^{-1} b + (c_{nb}^T - c_b^T A_b^{-1} A_{nb}) x_{nb} \rightarrow \max \\ x_b = A_b^{-1} b - A_b^{-1} A_{nb} x_{nb} \\ x_b \geq 0, x_{nb} \geq 0 \end{cases} \quad (4)$$

Определение: (4) называется *канонической формой* (не путать со стандартной формой!) ЗЛП, отвечающей базису x_b .

Признаки канонической формы:

1. Базисные переменные выражены через небазисные
2. В выражении для целевой функции отсутствуют базисные переменные.

Так как оптимальное решение ЗЛП достигается на БДР, то обозначим x_{nb} :

$$f = c_b^T A_b^{-1} b = f_0$$

$$x^0 = \begin{bmatrix} A_b^{-1} b \\ 0 \end{bmatrix}$$

Будем считать, что $x^0 \geq 0$, то есть x^0 - БДР.

Замечание: Именно по этому излагаемый метод называется симплекс методом при известном БДР.

Для того, чтобы перейти к новому БДР, достаточно:

1. Выбрать некоторую небазисную переменную для включения в базис
2. Выбрать некоторую базисную переменную для исключения из базиса

При этом такая замена одной базисной переменной на другую должна удовлетворять следующим условиям:

1. Значение функции f на новом БР должно быть больше (не меньше) значения f на текущем БДР. (принцип оптимальности)
2. Новое базисное решение должно быть допустимо (принцип допустимости)

Рассмотрим (4):

$$\begin{cases} f = f_0 + dx_{nb} \rightarrow \max \\ x_b = \alpha - Bx_{nb} \\ x_b \geq 0, x_{nb} \geq 0, \end{cases}$$

$$f_0 = c_b^T A_b^{-1} b$$

$$d = c_{nb}^T - c_b^T A_b^{-1} A_{nb}$$

$$\alpha = A_b^{-1} b$$

$$B = A_b^{-1} A_{nb}$$

$$f = f_0 + d_{m+1}x_{m+1} + \dots + d_n x_n \quad (5)$$

Если небазисные некоторые переменные x_j будут включена в базис, то значение целевой функции на новом БР будет равно $f_0 + d_j x_j$, где x_j^0 — значение x_j в текущем БР, так как все небазисные переменные кроме x_j в новом БР будут равны 0, а x_j став базисной может принять положительно значение.

Так как $f \rightarrow \max$, то в базис следует включать ту переменную x_j , для которой $d_j > 0$. Принцип оптимальности заключается в том, чтобы взять в базис такую переменную x_j , для которой d_j максимальное, то есть

$$d_k = \max \{d_j : d_j > 0\}, \quad j \in \text{небазисный индекс}$$

Если все $d_j \leq 0$, то текущее решение улучшить нельзя, таким образом оно оптимально.

Лекция 5

05 октября 2015

2) Выбор базисной переменной для исключения из базиса

Рассмотрим (4) в новом базисе, все переменные вектора x_{nb} , кроме x_k будут равны 0. Тогда запишем (4) в виде:

$$\begin{bmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_m \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \alpha_1 \\ \vdots \\ \alpha_m \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} \beta_1 \\ \vdots \\ \beta_m \end{bmatrix}$$
$$\begin{bmatrix} \alpha_1 \\ \vdots \\ \alpha_m \end{bmatrix} = A_b^{-1}b \quad \begin{bmatrix} \beta_1 \\ \vdots \\ \beta_m \end{bmatrix} - k\text{-ый столбец матрицы } A_b^{-1}A_{nb}$$

Предположим, что x_k в новом БДР приняла значение $x_k^0 \geq 0$. Это значит значение f увеличится на $d_k x_k^0$ (смотри (5)).

При увеличении x_k^0 одна или несколько компонент вектора x_b обнулятся, а при дальнейшем увеличении x_k^0 эти компоненты примут отрицательные значения. Таким образом максимальное возможное значение x_k^0 определяется условием:

$$x_k^0 = \min \left\{ \frac{\alpha_j}{\beta_j} : \beta_j > 0 \right\}, \quad j \in \text{базисным номерам}$$

Таким образом из базиса следует исключить ту переменную x_r , для которой достигается:

$$\frac{\alpha_r}{\beta_r} = \min \left\{ \frac{\alpha_j}{\beta_j} : \beta_j > 0 \right\}$$

Замечание: Если все $\beta_j \leq 0$, то целевая функция не ограничена на множестве допустимых решений (задача оптимизации не имеет решение).

Пример:

$$\begin{cases} f = x_1 + x_2 \rightarrow \max \\ -x_1 + x_2 \leq -1 \\ x_2 \leq 2 \\ x_1 \geq 0, x_2 \geq 0 \end{cases}$$

Решение:

в стандартной форме:

$$\begin{cases} f = x_1 + x_2 \rightarrow \max \\ x_1 - x_2 - x_3 = 1 \\ x_2 + x_4 = 2 \\ x_1, \dots, x_4 \geq 0 \end{cases}$$

$$(A|b) = \begin{bmatrix} \mathbf{1} & \mathbf{-1} & \mathbf{-1} & \mathbf{0} & \mathbf{1} \\ \mathbf{0} & \mathbf{1} & \mathbf{0} & \mathbf{1} & \mathbf{2} \end{bmatrix} \sim \begin{bmatrix} \mathbf{1} & \mathbf{0} & \mathbf{-1} & \mathbf{1} & \mathbf{3} \\ \mathbf{0} & \mathbf{1} & \mathbf{0} & \mathbf{1} & \mathbf{2} \end{bmatrix}$$

(выделенные **жирным** - базисные переменные, то есть x_1 и x_2)

$$\begin{cases} x_1 = 3 + x_3 - x_4 \\ x_2 = 2 - x_4 \end{cases}$$

$$\begin{cases} f = 5 + 1 \cdot x_3 - 2x_4 \\ x_1 = 3 + x_3 - x_4 \\ x_2 = 2 - x_4 \\ x_1, \dots, x_4 \geq 0 \end{cases}$$

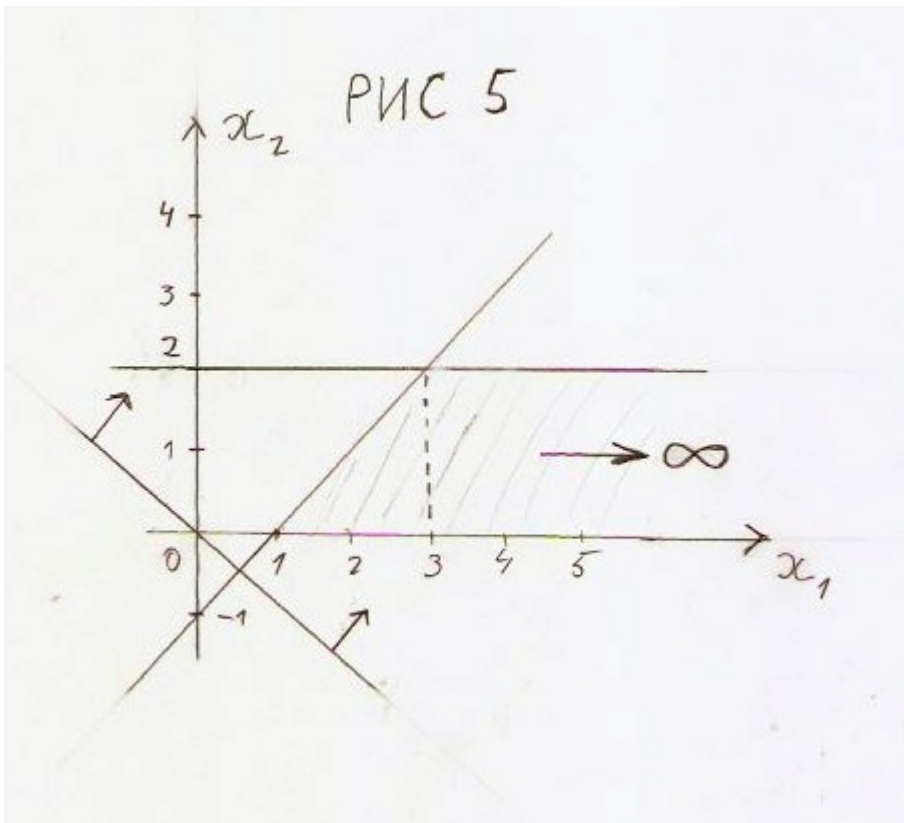
1. $d_3 = 1, d_4 = -2 \Rightarrow x_3$ в базис.

2. x_4 остается небазисной в новом БДР. $x_4 = 0$

$$\begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 3 \\ 2 \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} -1 \\ 0 \end{bmatrix} x_3$$

$$\beta_1 = -1 \quad \beta_2 = 0$$

Все $\beta_j \leq 0 \Rightarrow$ целевая функция не ограничена на множестве допустимых решений



Замечание: Если при $x_k = x_k^0$ в 0 обращается две или более базисных переменных, то из базиса может быть выведена любая из них, но только одна.

Пример: Решить ЗЛП

$$\begin{cases} f = 2x_1 + 5x_2 \rightarrow \max \\ x_1 \leq 400 \\ x_2 \leq 300 \\ x_1 + x_2 \leq 500 \\ x_1, x_2 \geq 0 \end{cases}$$

В стандартной форме ЗЛП:

$$\begin{cases} f = 2x_1 + 5x_2 \rightarrow \max \\ x_1 + x_3 = 400 \\ x_2 + x_4 = 300 \\ x_1 + x_2 + x_5 = 500 \\ x_1, \dots, x_5 \geq 0 \end{cases}$$

Замечание: В рассматриваемом примере все ограничения имеют вид неравенств « \leq » с положительными (не отрицательными) правыми частями. Это значит, что дополнительные переменные x_3, x_4, x_5 можно включить в начальный базис, при этом соответствующее БР будет допустимо.

В качестве базисных переменных возьмем x_3, x_4, x_5 :

$$\left[\begin{array}{ccccc|c} 1 & 0 & 1 & 0 & 0 & 400 \\ 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 300 \\ 1 & 1 & 0 & 0 & 1 & 500 \end{array} \right]$$

$$\begin{cases} x_3 = 400 - x_1 \\ x_4 = 300 - x_2 \\ x_5 = 500 - x_1 - x_2 \\ f = 2x_1 + 5x_2 \end{cases}$$

$$d_1 = 2, \quad d_2 = 5$$

d_2 — максимальное среди положительных, тогда x_2 в базис. x_1 остается небазисной, тогда:

$$\begin{bmatrix} x_3 \\ x_4 \\ x_5 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 400 \\ 300 \\ 500 \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix} x_2$$

$$\min \left\{ \frac{\alpha_j}{\beta_j} : \beta_j > 0 \right\}$$

$$\beta_4 = 1 \quad \beta_5 = 1$$

$$\frac{\alpha_4}{\beta_4} = \frac{300}{1} \quad \frac{\alpha_5}{\beta_5} = \frac{500}{1}$$

x_4 из базиса

2-ая итерация

x_2, x_3, x_4 - базис

Построим канон. форму ЗЛП для этого:

$$\left[\begin{array}{ccccc|c} 1 & \mathbf{0} & \mathbf{1} & 0 & \mathbf{0} & 400 \\ 0 & \mathbf{1} & \mathbf{0} & 1 & \mathbf{0} & 300 \\ 1 & \mathbf{1} & \mathbf{0} & 0 & \mathbf{1} & 500 \end{array} \right] \sim \left[\begin{array}{ccccc|c} 1 & \mathbf{0} & \mathbf{1} & 0 & \mathbf{0} & 400 \\ 0 & \mathbf{1} & \mathbf{0} & 1 & \mathbf{0} & 300 \\ 1 & \mathbf{0} & \mathbf{0} & -1 & \mathbf{1} & 200 \end{array} \right]$$

$$\begin{cases} x_2 = 300 - x_4 \\ x_3 = 400 - x_1 \\ x_5 = 200 - x_1 + x_4 \\ f = 2x_1 + 5x_2 = 1500 + 2x_1 - 5x_4 \end{cases}$$

$$d_1 = 2 \quad d_4 = -5$$

x_1 в базис. x_4 останется небазисной, значит $x_4 = 0$. Получаем:

$$\begin{bmatrix} x_2 \\ x_3 \\ x_5 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 300 \\ 400 \\ 200 \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix} x_4$$

$$x_b = \begin{bmatrix} x_2 \\ x_3 \\ x_5 \end{bmatrix} \quad \alpha = \begin{bmatrix} 300 \\ 400 \\ 200 \end{bmatrix} \quad \beta = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix}$$

$$\frac{\alpha_3}{\beta_3} = \frac{400}{1} \quad \frac{\alpha_5}{\beta_5} = \frac{200}{1} \Rightarrow x_5 \text{ из базиса}$$

3-ая итерация

x_1, x_2, x_3 - базис

Строим каноническую форму для этого базиса:

$$(A|b) = \left[\begin{array}{ccccc|c} 1 & 0 & 1 & 0 & 0 & 400 \\ 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 300 \\ 1 & 0 & 0 & -1 & 1 & 200 \end{array} \right] \sim \left[\begin{array}{ccccc|c} 0 & 0 & 1 & 1 & -1 & 200 \\ 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 300 \\ 1 & 0 & 0 & -1 & 1 & 200 \end{array} \right]$$

$$\begin{cases} x_1 = 200 + x_4 - x_5 \\ x_2 = 300 - x_4 \\ x_3 = 200 - x_4 + x_5 \\ f = 1500 + 2x_1 - 5x_4 = 1900 - 3x_4 - 2x_5 \end{cases}$$

$$d_4 = -3 \quad d_5 = -2$$

Все $d_j \leq 0 \Rightarrow$ текущая БДР оптимальная.

Ответ:

$$x^{opt} = \begin{bmatrix} 200 \\ 300 \\ 200 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix}$$

$$f^{opt} = f(x^{opt}) = 1900$$

Проведенные вычисления удобно организовать в так называемой *симплекс таблице*:

$$\begin{cases} f = 2x_1 + 5x_2 \rightarrow \max \\ x_1 + x_3 = 400 \\ x_2 + x_4 = 300 \\ x_1 + x_2 + x_5 = 500 \\ x_1, \dots, x_5 \geq 0 \end{cases}$$

x_3, x_4, x_5 - начальный базис

Итерация	Базисные переменные	Значения	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	$\frac{\alpha_i}{\beta_j}$	Итог
1	x_3	400	1	0	1	0	0		x_4 из базиса, x_2 в базис
	x_4	300	0	1	0	1	0	$\frac{300}{1}$	
	x_5	500	1	1	0	0	1	$\frac{500}{1}$	
	$-f$	0	2	5	0	0	0		
2	x_3	400	1	0	1	0	0	$\frac{400}{1}$	x_5 из базиса, x_1 в базис
	x_2	300	0	1	0	1	0		
	x_5	500	1	0	0	-1	1	$\frac{200}{1}$	
	$-f$	-1500	2	0	0	0	0		
3	x_3	200	0	0	1	1	-1		Оптимальное
	x_2	300	0	1	0	1	0		
	x_1	500	1	0	0	-1	1		
	$-f$	-1900	0	0	0	-3	-2		

4.2 Построение начального БДР

В рассмотренных выше примерах начальное БДР отвечало либо m первым столбцам матрицы A , либо дополнительным переменным. В общем случае это не так и для построения начального БДР нужна регулярная процедура.

Рассмотрим ЗЛП в стандартной форме:

$$\begin{cases} f(x) \rightarrow \max \\ Ax = b \\ x \geq 0, \end{cases},$$

где $b \geq 0$, $\text{rg} A = \text{rg}(a|B) = m < n$. m — число ограничений, n — число переменных.

Построение начального БДР можно свести к решению вспомогательной ЗЛП.

Рассмотрим ЗЛП:

$$\begin{cases} w = I^T y \rightarrow \max \\ Ax + y = b \\ x \geq 0, y \geq 0, \end{cases}$$

$$y = \begin{bmatrix} y_1 \\ \vdots \\ y_m \end{bmatrix} \quad I = \begin{bmatrix} 1 & & \\ & \ddots & \\ & & 1 \end{bmatrix} \in R^n$$

$$w = -(y_1 + \dots + y_m) \rightarrow \max$$

Определение: Переменные y_1, \dots, y_m называются искусственными.

1. Для этой задачи переменные y_1, \dots, y_m могут быть использованы в качестве начального базиса
2. $w \leq 0$, а при $y = \vec{0}$, $w = 0 \Rightarrow$ после решения этой ЗЛП переменные $y_1, \dots, y_m = 0$, исключаются из базиса и более не рассматриваются. Текущий базис из переменных x_j используются в качестве начального для решения исходных ЗЛП.

Замечание: Если $w_{opt} < 0$ (то есть $y^{opt} \neq 0$), то исходная ЗЛП не имеет допустимых решений. $w \rightarrow \max, w \neq 0$ за счет того, что для $y = 0$ не выполняется ограничение задачи, тогда равенство $Ax + y = b$ не может быть выполнено при $y = 0$.

Лекция 6

12 октября 2015

Пример:

$$\begin{cases} f = 3x_1 + 4x_2 \rightarrow \max \\ x_1 \geq 10 \\ x_2 \geq 5 \\ x_1 + x_2 \leq 20 \\ -x_1 + 4x_2 \leq 20 \\ x_1, x_2 \geq 0 \end{cases}$$

$$\begin{cases} f = 3x_1 + 4x_2 \rightarrow \max \\ x_1 - x_3 = 10 \\ x_2 - x_4 = 5 \\ x_1 + x_2 + x_5 = 20 \\ -x_1 + 4x_2 + x_6 = 20 \\ x_1, \dots, x_6 \geq 0 \end{cases}$$

Переменные x_1, x_2 — небазисные, тогда $x_1 = x_2 = 0$,

$$x_3 = -10 < 0$$

$$x_4 = -15 = 0$$

Что плохо

$$x_5 = 20 \geq 0$$

$$x_6 = 20 \geq 0$$

Что хорошо.

$$\begin{cases} f = 3x_1 + 4x_2 \rightarrow \max \\ x_1 - x_3 + y_1 = 10 \\ x_2 - x_4 + y_2 = 5 \\ x_1 + x_2 + x_5 = 20 \\ -x_1 + 4x_2 + x_6 = 20 \\ x_1, \dots, x_6 \geq 0 \\ y_1, y_2 \geq 0 \end{cases}$$

x_1, x_2, x_3, x_4 — небазисные.

y_1, y_2, x_5, x_6 — базисные, тогда

$$\begin{cases} \text{в соответствии с БР} \\ y_1 = 10 \\ y_2 = 5 \\ x_5 = x_6 = 20 \end{cases}$$

,

тогда БР является БДР.

x_3, \dots, x_6 называются дополнительными переменными, y_1, y_2 называются искусственными.

$$w = -(y_1 + y_2) = -25 + x_1 + x_2 - x_3 - x_4 \rightarrow \max$$

Из первого ограничения $-y_1 = -10 + x_1 - x_3$, из второго ограничения $-y_2 = -5 + x_2 - x_4$

Итерация	БП	Значения	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	x_6	y_1	y_2	$\frac{\alpha_i}{\beta_i}$	Итог
1	y_1	10	1	0	-1	0	0	0	1	0	$\frac{10}{1}$	y_1 из базиса, x_1 в базис
	y_2	5	0	1	0	1	0	0	0	1		
	x_5	20	1	1	0	0	1	0	0	0	$\frac{20}{1}$	
	x_6	20	-1	4	0	0	0	1	0	0		
	$-f$	0	3	4	0	0	0	0	0	0		
	$-w$	15	1	1	-1	-1	0	0	0	0		
2	x_1	10	1	0	4	0	0	0	1	0		y_2 из базиса, x_2 в базис
	y_2	5	0	1	0	-1	0	0	0	1	$\frac{5}{1}$	
	x_5	10	0	1	1	0	1	0	-1	0	$\frac{10}{1}$	
	x_6	30	0	4	-1	0	0	1	1	0	$\frac{15}{2}$	
	$-f$	-30	0	4	3	0	0	0	-3	0		
	$-w$	5	0	1	0	-1	0	0	-1	0		
3	x_1	10	1	0	-1	0	0	0	1	0		Строка для w оптимальные $y_1, y_2 = 0$. x_1, x_2, x_5, x_6 — начальный базис x_6 из базиса x_4 в базис
	x_2	5	0	1	0	-1	0	0	0	1	$\frac{5}{1}$	
	x_5	5	0	0	1	1	1	0	-1	-1	$\frac{10}{4}$	
	x_6	10	0	0	-1	4	0	1	1	-4	$\frac{15}{2}$	
	$-f$	-50	0	0	3	4	0	0	-3	-4		
	$-w$	0	0	0	0	0	0	0	-1	-1		

Итерация	БП	Значения	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	x_6	Итог
4	x_1	10	1	0	-1	0	0	0	x_4 из базиса
	x_2	7.5	0	1	-1/4	0	0	1/4	
	x_5	2.5	0	0	5/4	0	1	-1/4	
	x_4	2.5	0	0	-1/4	1	0	1/4	
	$-f$	-60	0	0	4	0	0	-1	
5	x_1	12	1	0	0	0	4/5	-1/5	x_3 в базис
	x_2	8	0	1	0	0	1/5	1/5	
	x_3	2	0	0	1	0	4/5	-1/5	
	x_4	3	0	0	0	1	1/5	1/20	
	$-f$	-68	0	0	0	0	-16/5	-1/5	

$$f^{opt} = 68$$

$$x^0 = \begin{bmatrix} 12 \\ 8 \\ 2 \\ 3 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix}$$

5 Двойственная задача

5.1 Определение

Определение: Стандартной формой прямой задачи называют задачу вида:

$$\begin{cases} f = c^T x \rightarrow \max \\ Ax \leq b \\ x \geq 0 \end{cases} \quad (6)$$

(не обязательно $b \geq 0$)

Признаки стандартной формы прямой задачи:

1. Целевая функция максимизируется
2. Все ограничения имеют вид \leq
3. Все переменные подчинены условию неотрицательности

Замечание Ниже мы покажем, что любая ЗЛП может быть приведена к стандартной форме простой задачи

Определение: Задачей двойственности к (6), называется ЗЛП вида

$$\begin{cases} g = b^T y \rightarrow \min \\ A^T y \geq c \\ y \geq 0 \end{cases} \quad (7)$$

При этом (7) называется стандартной формой двойственной задачи

Пример:

$$\begin{cases} f = x_1 - 4x_2 - 3x_3 \rightarrow \min \\ 3x_1 + 4x_2 + x_3 \leq 7 \\ x_3 \geq 4 \\ x_1 + 2x_2 + x_3 = 6 \\ x_1, x_2, x_3 \geq 0 \end{cases}$$

Составим двойственную задачу

Решение

Приведем к стандартной форме простой задачи:

$$\begin{cases} f_1 = -f = -x_1 + 4x_2 + 3x_3 \rightarrow \max \\ 3x_1 + 4x_2 + x_3 \leq 7 & (y_1) \\ -x_3 \leq -4 & (y_2) \\ x_1 + 2x_2 + x_3 \leq 6 & (y'_3) \\ -x_1 - 2x_2 - x_3 \leq -6 & (y''_3) \\ x_1, x_2, x_3 \geq 0, \text{ так как:} \end{cases}$$

$$\left(a = b \Leftrightarrow \begin{cases} a \leq b \\ a \geq b \end{cases} \right)$$

Двойственная задача:

$$\begin{cases} g = 7y_1 - 4y_2 + 6y'_3 - 6y''_3 \rightarrow \min \\ 3y_1 + 0y_2 + y'_3 - y''_3 \geq -1 \\ 4y_1 + 0y_2 + 2y'_3 - 2y''_3 \geq 4 \\ y_1 - y_2 + y'_3 - y''_3 \geq 3 \\ y_1, y_2, y'_3, y''_3 \geq 0 \end{cases}$$

$$y_3 = y'_3 - y''_3$$

$$\begin{cases} g = 7y_1 - 4y_2 + 6y_3 \rightarrow \min \\ 3y_1 + 0y_2 + y_3 \geq -1 \\ 4y_1 + 0y_2 + 2y_3 \geq 4 \\ y_1 - y_2 + y_3 \geq 3 \\ y_1, y_2, y_3 \geq 0 \end{cases}$$

Замечание:

1. Число ограничений двойственной задачи равно числу переменных прямой задачи
2. Число переменных двойственной задачи равно числу ограничений прямой задачи
3. Если некоторое ограничение прямой задачи является равенством, то соответствующая переменная двойственной задачи не ограничена в знаке.

Пример: Составить двойственную задачу для

$$\begin{cases} f = 6x_1 + 10x_2 \rightarrow \max \\ 5x_1 + 3x_2 \geq 10 \\ x_1 - x_2 \leq 4 \\ x_1 \geq 0 \\ x_2 \text{ не ограничена в знаке} \end{cases}$$

Приведем к стандартной форме простой задачи:

$$\begin{cases} f = 6x_1 + 10x_2 \rightarrow \max \\ -5x_1 - 3x_2 \leq -10 \\ x_1 - x_2 \leq 4 \\ x_1 \geq 0 \\ x_2 = x'_2 - x''_2 \\ x'_2, x''_2 \geq 0 \end{cases}$$

Стандартная форма простой задачи:

$$\begin{cases} f = 6x_1 + 10x_2' - 10x_2'' \rightarrow \max \\ -5x_1 - 3x_2' + 3x_2'' \leq -10 \\ x_1 - x_2' + x_2'' \leq 4 \\ x_1 \geq 0 \\ x_2', x_2'' \geq 0 \end{cases}$$

Двойственная задача

$$\begin{cases} g = -10y_1 + 4y_2 \rightarrow \min \\ -5y_1 + y_2 \geq 6 \\ -3y_1 - y_2 \geq 10 \\ 3y_1 + y_2 \geq -10 \equiv -3y_1 - y_2 \leq 10 \\ y_1, y_2 \geq 0 \end{cases}$$

$$\begin{cases} g = -10y_1 + 4y_2 \rightarrow \min \\ -5y_1 + y_2 \geq 6 \\ -3y_1 - y_2 \geq 10 \\ 3y_1 - y_2 = -10 \\ y_1, y_2 \geq 0 \end{cases}$$

Замечание: Таким образом если некоторая переменная принимает значение не ограничена в знаке, то её соответствующее ограничение двойственной задачи является равенством.

5.2 Основные соотношения двойственности

Теорема 1: Задача, двойственная к двойственной, эквивалентна прямой задаче.

Доказательство

Прямая задача:

$$\begin{cases} f = c^T x \rightarrow \max \\ Ax \leq b \\ x \geq 0 \end{cases}$$

Двойственная задача:

$$\begin{cases} g = b^T y \rightarrow \min \\ A^T y \geq c \\ y \geq 0 \end{cases}$$

Двойственная задача в стандартной форме прямой задачи

$$\begin{cases} g_1 = (-b^T) y \rightarrow \max \\ (-A^T) y \leq -c \\ y \geq 0 \end{cases}$$

Задача двойственная к двойственной:

$$\begin{cases} h = (-c^T) z \rightarrow \min \\ (-A^T)^T z \geq -b \\ z \geq 0 \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} h_1 = c^T z \rightarrow \max \\ Az \geq -b \\ z \geq 0 \end{cases}$$

Меняем z на x и получаем прямую задачу

Конец доказательства

Теорема 2: Пусть:

1. Прямая задача имеет **дополнительное** решение \hat{x}
2. Двойственная задача имеет **дополнительное** решение \hat{y}

Тогда $f(\hat{x}) \leq g(\hat{y})$

Доказательство

Прямая задача:

$$\begin{cases} f = c^T x \rightarrow \max \\ Ax \leq b \\ x \geq 0 \end{cases}$$

Двойственная задача:

$$\begin{cases} g = b^T y \rightarrow \min \\ A^T y \geq c \\ y \geq 0 \end{cases}$$

1. Так как \hat{x} допустим $\Rightarrow A\hat{x} \leq b$, умножим обе части \hat{y}^T слева и получим $\hat{y}^T A\hat{x} \leq \hat{y}^T b$. Левая и правая часть — скаляры, тогда получим $\hat{x}^T A^T \hat{y} \leq b^T \hat{y}$
2. Так как \hat{y} допустим $\Rightarrow A^T \hat{y} \geq c$, умножим на $\hat{x}^T \geq 0$ справа и слева и получим $\hat{x}^T A^T \hat{y} \geq \hat{x}^T c \Rightarrow \hat{x}^T A^T \hat{y} \geq c^T \hat{x} = f(\hat{x})$
3. Таким образом $f(\hat{x}) \leq g(\hat{y})$

Конец доказательства

Следствие: Если целевая функция прямой задач не ограничена (сверху y) на множестве допустимых решений, то множество допустимых решений двойственной задачи пусто.