Universidade Estadual de Campinas
Instituto de Matemática, Estatística e Computação Cientifica

Relatório
Algoritmo do método primal simplex

Hugo Calegari RA:155738
Leonardo Uchoa Pedreira RA:156231

Professora: Kelly Cristina Poldi

Campinas-SP, 26 de Outubro de 2017

1 Comentários sobre o código (funcsimplex) para o algoritmo do método primal simplex

Utiliza como entrada as seguintes variáveis: m, n, A, b e c que são, respectivamente, o número de linhas da matriz A, colunas de A, a matriz A com as variáveis de folga incluídas, o vetor de variáveis livres e o vetor de custos. (b e c devem ser inicializadas como vetores coluna, portanto devem ser transpostos.) A saída pode ser exibida de duas maneiras semelhantes: a primeira é com a saída do valor ótimo de x (xot) com a função objetivo mínima (fot); a segunda é com o valor ótimo de x (xot) com a função objetivo mínima (fot) e o número máximo de iterações (h) realizadas para se chegar no resultado encontrado. Observe que o valor associado ao número de iterações (h) está relacionado com a última iteração cujos custos relativos são maiores ou iguais a zero e consequentemente o algoritmo para.

No desenvolvimento da função encontra-se a inicialização de x com as entradas todas nulas, que posteriormente será preenchida com seus devidos valores para a partição básica e como a não básica é nula mantém-se estes valores. O vetor inicializado C simplesmente se concentra em identificar as colunas da matriz A que representam a matriz identidade. (Como o código foi feito ao se considerar o problema $Ax \leq b$, basta considerar as últimas colunas de A com as variáveis de folga incluídas.)

O componente principal da função é um loop ("for"), no qual a cada iteração (atualização) é possível identificar:

1) A partição básica pelo comando (matriz): "B=A(:,C)" e sua inversa por: "invB = inv(B)";

2) A solução básica inicial (vetor): "x(C) = invB*b";

3) O custo básico (vetor): "cB = c(C)";

4) O vetor multiplicador simplex: "lambda = (cB'*invB)' ";

5) O vetor de custos relativos: "cr = c' - lambda'*A";

6) Identificação de custos relativos menores que zero: "H = find(cr $<$ 0)" e, com isso, por meio de uma estrutura condicional verifica-se se o vetor H é nulo ou não. Caso for nulo, ou seja, não há custos relativos menores que zero, então chegou-se na solução ótima; caso contrário continue;

7) Dado 6, encontrado os custos relativos menores que zero, determina-se o índice de "cr" com o menor valor de custo relativo (regra de Dantzig) por: "jsuporte = (find(min(cr(H)) == cr))" e "jentra = jsuporte(1)"; uma vez que pode-se ter mais do que um índice de "cr" com o mesmo custo relativo mínimo, a variável "jentra" foi criada com o objetivo de armaznar o primeiro índice com o custo mínimo repetido da variável "jsuporte";

8) Cálculo da direção simplex pelo vetor: "y = invB*A(:,jentra)";

9) Identificação dos índices com as direções que são estritamente maiores que zero por (para posteriormente o cálculo do tamanho do passo): "I = find(y $>$ 0)";

10) Caso não haja nenhuma direção que seja estritamente maior que zero, isso quer dizer que tem-se um problema ilimitado, identificada pela estrutura condicional: "if (isempty(I))";

11) Determinação do tamanho do passo por: "epsilon = min(x(C(I))./y(I))" e, posteriormente, identifiação do índice que sairá da base por: "L = find(x(C)./y == epsilon)";

12) Adoção da estratégia simplex, com isso as variáveis básicas devem ser alteradas e calculadas como o seguinte vetor: "x(C) = x(C) - epsilon*y";

13) A variável que era considerada não básica e assim assumia valor nulo, agora, altera-se e assume o valor epsilon de acordo com o comando: “x(jentra) = epsilon”;

14) A atualização dos índices que fazem parte da base é escrito como segue: “C(lsai) = jentra”;

15) Por fim, existe uma estrutura condicional para verifical se o número de iterações máximo foi atingido ou não. Caso tenha atingido e não encontrado a solução ótima por este motivo, deve-se alterar o valor de “maxit” para o valor desejado. Observe que de início o valor determinado para “maxit” foi de 20 iterações (valor designado de maneira arbitrária).

2 Como aplicar a função

A função do algoritmo simplex, para determinar a solução ótima ou identificar uma solução ilimitada, foi definida como funcsimplex.m. Esta função construída lida com problemas de programação linear da forma:

$$\begin{array}{ll} \text{minimizar} & f(x) = c^t x \\ \text{sujeito a:} & Ax \leq b, x \geq 0. \end{array}$$

Na forma padrão, tem-se que:

$$\begin{array}{ll} \text{minimizar} & f(x) = c^t x + 0^t s \\ \text{sujeito a:} & Ax + s = b, x \geq 0, s \geq 0 \end{array}$$

de tal forma que os custos são reajustados, ou seja, na forma padrão tem-se que os custos relacionados com as variáveis de folga são nulos.

Para executar o algoritmo, deve-se verificar o local onde se salvou a função (o diretório onde encontrá-la). Com o Matlab ou Octave aberto digitar, por exemplo (sem as aspas duplas): “cd ’Área de trabalho/’” ou “cd Downloads/”. Com isso, o Matlab ou Octave já identifica os conteúdos do diretório, inclusive o arquivo relacionado com a função elaborada em extensão “.m” (funcsimplex.m).

Como **entrada**, o usuário fornece o número de linhas e colunas (m e n, respectivamente) da Matriz A na forma **padronizada** (folgas incluídas), fornece a própria matriz A com as variáveis de **folga incluídas**, fornece os vetores **transpostos** b e c relacionados com as restrições e os custos (com os custos nulos das variáveis de folga), respectivamente. Veja a seguir alguns exemplos de como fazer para inicializar as variáveis mencionadas.

1) O número de linhas e colunas da matriz A pode ser fornecida, por exemplo, como: “m = 3; n = 5;”.

2) A matriz A dever ser fornecida por linha. Por exemplo, colocar como entrada a seguinte matriz matriz:

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 & 0 \\ 3 & 4 & 0 & 1 \end{bmatrix}.$$

Neste caso, deve-se digitar como segue (sem as aspas. Veja que o ponto e vírgula no final da linha é simplesmente para que a matriz A não seja impressa depois da sua inicialização): “A = [1 2 1 0; 3 4 0 1];”, ou seja, as informações são por linha.

3) Os vetores b e c devem ser fornecidos da mesma maneira que a matriz A, mas devem ser transpostos. Seja o exemplo de fornecer como entrada:

$$b = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \end{bmatrix}$$

$$c = \begin{bmatrix} 5 \\ 6 \\ 7 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix}.$$

Para isso deve-se escrever os seguintes comandos (sem o sinal das aspas): “b = [1 2]’;” e “c = [5 6 7 0 0]’;”. Observe que deve-se colocar o sinal da transposição dos vetores de b e c, caso contrário eles serão considerados como vetores linha e terá problemas na execução do algoritmo.

Uma vez inicializada as variáveis de interesse, a maneira de executar o algoritmo para se obter a solução ótima com a função objetivo associada a esta é como se segue:

[xot, fot] = funcsimplex(m,n,A, b, c) (caso se queira ver somente o resultado de x ótimo com o valor associado da função objetivo f) e outra forma de se chamar a função é: [xot, fot, h] = funcsimplex(m,n,A, b, c) (nesta maneira as saídas são: x ótimo que minimiza a função objetivo f e o valor de f em x ótimo, e o número de iterações necessárias/realizadas (identificado como h) para se obter a solução ótima).

Observação: a parte da função [xot, fot] ou [xot, fot, h] estão relacionadas com as saídas da função e funcsimplex(m,n,A, b, c) está relacionada com as entradas da função; observe que o símbolo ’ nos vetores b e c referem-se as transposições destes.

Exemplos:

1) m = 3; n = 6; A = [1 2 2 1 0 0; 2 1 2 0 1 0; 2 2 1 0 0 1]; b = [20 20 20]’; c = [-10 -12 -12 0 0 0]’;. Lembre-se de que o símbolo ’ nos vetores b e c referem-se as transposições destes. A resposta esperada ou solução ótima esperda é:

xot = [4 4 4 0 0 0]’, fot = -136, ou seja, xot = [4 4 4 0 0 0]’ com função objetivo: fot = -136.
Observação à respeito de x e a solução ótima xot. Lembre-se, neste caso, de que x = [x_1 x_2 x_3 x_4 x_5 x_6]’, ou seja, a parte [x_1 x_2 x_3]’ do vetor coluna x são as variáveis do problema e a parte [x_4 x_5 x_6]’ do vetor x são as variáveis de folga. Com isso, a solução ótima encontrada para este exemplo representa: $x_1 = x_2 = x_3 = 4$ e $x_4 = x_5 = x_6 = 0$ (variáveis de folga nulas caracterizam restrições ativas);

Exemplos obtidos das listas de exercício.

2) m = 2; n = 4; A=[-1 1 1 0; 2 -1 0 1]; b = [2 6]’; c = [-1 -1 0 0]’;. A resposta esperada ou solução ótima esperda é:

xot = [8 10 0 0]’, fot = -18, ou seja, xot = [8 10 0 0]’ com função objetivo: fot = -18.
Observação à respeito de x e a solução ótima xot. Neste caso, x = [x_1 x_2 x_3 x_4]’, ou seja, a parte [x_1 x_2]’ do vetor coluna x são as variáveis do problema e a parte [x_3 x_4]’ do vetor x são as variáveis de folga. Com isso, a solução ótima encontrada para este exemplo representa: $x_1 = 8$, $x_2 = 10$, $x_3 = x_4 = 0$ (variáveis de folga nulas caracterizam restrições ativas);

3) m = 3; n = 5; A = [1 1 1 0 0; 1 0 0 1 0; 0 1 0 0 1]; b = [4 3 7/2]'; c = [-2 -1 0 0 0]';. A resposta esperada ou solução ótima esperda é:

xot = [3 1 0 0 2.5]', fot = -7, ou seja, xot = [3.0 1.0 0.0 0.0 2.5]' com função objetivo: fot = -7.
Observação à respeito de x e a solução ótima xot. Lembre-se, neste caso, de que x = [x_1 x_2 x_3 x_4 x_5]', ou seja, a parte [x_1 x_2]' do vetor coluna x são as variáveis do problema e a parte [x_3 x_4 x_5]' do vetor x são as variáveis de folga. Com isso, a solução ótima encontrada para este exemplo representa: $x_1 = 3$, $x_2 = 1$, $x_3 = x_4 = 0$ e $x_5 = 2.5$ (neste caso somente duas restrições foram ativadas);

4) m = 2; n = 6; A = [1 1 -1 0 1 0; -1 1 0 -1 0 1]; b = [2 1]'; c = [0 0 0 0 1 1]';. A resposta esperada ou solução ótima esperda é:

xot = [0.5 1.5 0 0 0 0]', fot = 0, ou seja, xot = [0.5 1.5 0.0 0.0 0.0 0.0]' com função objetivo: fot = 0.
Observação à respeito de x e a solução ótima xot. Lembre-se, neste caso, de que x = [x_1 x_2 x_3 x_4 x_5 x_6]', ou seja, a parte [x_1 x_2 x_3 x_4]' do vetor coluna x são as variáveis do problema e a parte [x_5 x_6]' do vetor x são as variáveis de folga. Com isso, a solução ótima encontrada para este exemplo representa: $x_1 = 0.5$, $x_2 = 1.5$, $x_3 = x_4 = x_5 = x_6 = 0$ (variáveis de folga nulas caracterizam restrições ativas);

5)Exemplo de problema ilimitado: m = 2; n = 4; A = [-1 -1 1 0; -3 -5 0 1]; b = [8 30]'; c = [-4 -5 0 0]';. A resposta esperada ou solução ótima esperda é:

Problema ilimitado!

xot = [](0x0), fot = - ∞, ou seja, não existe um único xot e, assim, um único fot. Ao encontrar um valor de xot tal que fot é mínimo é possível determinar outro par de xot* e fot* que seja menor que o anterior encontrado. Com isso, o problema é ilimitado.