

Ricerca operativa

Mario Petruccelli
Università degli studi di Milano

A.A. 2018/2019

Sommario

1	Introduzione	3
1.1	Tassonomia modelli	3
1.2	Programmazione matematica	3
2	Esempi di problemi	4
2.1	Problema dello zaino	4
2.2	Problema di trasporto e localizzazione di impianti	5
2.3	Problema assegnamento	6
2.4	Mix Produttivo	6
2.4.1	Vernici	7
2.4.2	Problema della dieta	8
2.5	Miscelazione	9
2.6	Turnazione personale	10
2.7	Locazione di servizi	11
2.8	Bin packing	12
2.9	Problema di assegnamento	13
2.10	Problema di sequenziamento monoprocesso	14
2.11	Problema di pianificazione della produzione	15
2.11.1	Variante lotto minimo	16
2.11.2	Variante produzione con costi fissi	17
2.11.3	Variante multiprodotto	17

1 Introduzione

Ricerca operativa: disciplina che affronta la risoluzione di problemi decisionali complessi tramite modelli matematici e algoritmi. Si parte da un **sistema organizzato** e lo si formalizza in un **modello matematico** per poi risolverlo tramite **algoritmi**.

1.1 Tassonomia modelli

- **Descrittivi** → Modelli che cercano di descrivere o simulare sistemi complessi (*e.g. modellini, plastici, ...*)
- **Predittivi** → Modelli che cercano di predire dei dati (*e.g. andamento mercati finanziari, previsioni, ...*)
- **Prescrittivi** → Modelli che trovano la soluzione ottimale ad un problema (*sono quelli che studieremo in questo corso*).

La descrizione del problema avverrà attraverso **vincoli, obiettivi**.

Esempio di problemi decisionali

- Finanza (investimenti)
- Produzione (dimensionamento, organizzazione, ...)
- Logistica (gestione scorte, quanta merce, ...)
- Gestione (pianificazione, turnistica personale, ...)
- Servizi (rotte, ...)

NB *Lo stesso modello può servire per risolvere problemi diversi.*

Set covering Problema per la gestione di un territorio. I problemi dei sismografi e dei ripetitori sono diversi ma si ragiona allo stesso modo.

1.2 Programmazione matematica

La programmazione matematica (intesa come *pianificazione* delle azioni necessarie per individuare la soluzione ottima) è ciò che rappresenta il processo risolutivo nella ricerca operativa:

- Analisi del problema e scrittura di un modello matematico.
- Definizione e applicazione di un metodo di soluzione.

In particolar modo, la programmazione matematica si occupa di ottimizzare una funzione di più variabili, spesso soggette a dei vincoli. A seconda del tipo di modello abbiamo:

- Programmazione lineare continua.
- Programmazione lineare intera.
- Programmazione booleana.

2 Esempi di problemi

2.1 Problema dello zaino

Ci sono n oggetti di valore p_j e ingombro w_j per $j = 1 \dots n$ ed è data la capacità massima b di un contenitore.

Problema Quali oggetti inserire nel contenitore senza superare capacità.

Obiettivo Massimizzare il valore degli oggetti. Si tratta di un problema di **ottimizzazione** e va formalizzato in modello matematico. Ci sono 4 componenti fondamentali.

Dati I dati sono informazioni conosciute a priori, in questo caso sono:

- $p_j \rightarrow$ valore dell'oggetto j .
- $w_j \rightarrow$ ingombro dell'oggetto j .
- $b \rightarrow$ capacità massima del contenitore.

Variabili Le variabili sono elementi che rappresentano una decisione.

- $x_j = \begin{cases} 1 & \text{se il } j\text{-esimo oggetto viene inserito} \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$

Obiettivo L'obiettivo è la funzione che rappresenta il risultato da ottenere.

- $\max \sum_{j=1}^n p_j x_j \rightarrow$ massimizzare il valore

Vincoli I vincoli sono le limitazioni che abbiamo sui dati.

- $\sum_{j=1}^n w_j x_j \leq b \rightarrow$ la somma degli ingombri degli oggetti presi non può superare la capacità del contenitore
- $x_j \in \{0, 1\} \quad j = 1 \dots n$

2.2 Problema di trasporto e localizzazione di impianti

Ci sono n siti candidati ad ospitare unità produttive, ciascuno con capacità massima a_i con $i = 1 \dots n$. Vi sono m magazzini, ognuno con una domanda da soddisfare b_j con $j = 1 \dots m$. Indichiamo con c_{ij} il costo di trasporto di una unità di prodotto dal sito i al magazzino j . L'attivazione di una unità produttiva nel sito i ha un costo fisso f_i .

Problema Dove aprire le unità produttive e come trasportare il prodotto dalle unità produttive aperte ai magazzini in modo da soddisfare la domanda.

Obiettivo Minimizzare i costi di apertura e trasporto.

Dati

- $a_i \rightarrow$ capacità di produzione del sito i
- $b_j \rightarrow$ domanda del magazzino j
- $c_{ij} \rightarrow$ costo del trasporto di un'unità dal sito i al magazzino j .
- $f_i \rightarrow$ costo di attivazione unità nel sito i .

Variabili

- $y_i = \begin{cases} 1 & \text{se il sito } i \text{ ospita un'unità produttiva} \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$
- $x_{ij} =$ numero di unità trasportata dal sito i al magazzino j .

Obiettivo

- $\min \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m c_{ij} x_{ij} + \sum_{i=1}^n f_i y_i \rightarrow$ minimizzare il costo di attivazione di un unità nei vari siti e il costo dei trasporti delle unità.

Vincoli

- $\sum_{j=1}^m x_{ij} \leq a_i y_i \quad i = 1 \dots n \rightarrow$ le unità trasportate da un sito i non possono superare la capacità a_i di quel sito i .
- $\sum_{i=1}^n x_{ij} \geq b_j \quad j = 1 \dots m \rightarrow$ Le unità inviate ad un magazzino j dai vari siti deve soddisfare la domanda di quel magazzino.
- $x_{ij} \geq 0 \quad i = 1 \dots n \quad j = 1 \dots m$
- $y_i \in \{0, 1\} \quad i = 1 \dots n$

2.3 Problema assegnamento

Ci sono n lavoratori e n attività. Indichiamo con t_{ij} il tempo impiegato dal lavoratore i per svolgere l'attività j .

Problema Assegnare a ciascun lavoratore una sola attività, così che tutte le attività siano svolte.

Obiettivo Minimizzare il tempo richiesto a svolgere l'attività j .

Dati

- $t_{ij} \rightarrow$ tempo impiegato dal lavoratore i per svolgere l'attività j .

Variabili

- $x_{ij} = \begin{cases} 1 & \text{se il lavoratore } i \text{ svolge l'attività } j \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$

Obiettivo

- $\min \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n t_{ij} x_{ij} \rightarrow$ minimizzare il tempo speso per svolgere tutte le attività dei vari lavoratori.

Vincoli

- $\sum_{j=1}^n x_{ij} = 1 \quad \forall i \rightarrow$ a ogni lavoratore è associata una sola attività.
- $\sum_{i=1}^n x_{ij} = 1 \quad \forall j \rightarrow$ a ogni attività è associata nn solo lavoratore.
- $x_{ij} \in \{0, 1\} \quad \forall i, j$

2.4 Mix Produttivo

Si hanno m risorse produttive con disponibilità b_i . Si possono produrre n prodotti diversi. Per produrre una unità di un prodotto j -esimo si utilizzano a_{ij} unità della risorsa i -esima. Ciascun prodotto ha un profitto unitario c_j .

Dati

- $b_i \rightarrow$ disponibilità risorsa i -esima.
- $a_{ij} \rightarrow$ unità della risorsa i -esima usate per produrre un prodotto j -esimo.
- $c_j \rightarrow$ profitto di un unità del prodotto j .

Variabili

- x_j = unità prodotte del prodotto j -esimo.

Obiettivo

- $\max \sum_{j=1}^n c_j x_j \rightarrow$ massimizzare il profitto tra i vari prodotti.

Vincoli

- $\sum_{j=1}^n a_{ij} x_j \leq b_i \quad \forall i \rightarrow$ le risorse usate nella produzione non possono superare la disponibilità di ciascuna risorsa.
- $x_j \geq 0 \quad \forall j$

2.4.1 Vernici

L'azienda produce due tipi di vernici, una vernice per interni (I) e una vernice per esterni (E), usando due materie prime indicate con A e B. La disponibilità al giorno di materia prima A è pari a 6 ton, mentre quella di materia prima B è di 8 ton. La quantità di A e B consumata per produrre una ton di vernice E ed I è riportata nella seguente tabella.

		Vernici	
		E	I
Materie prime	A	1	2
	B	2	1

Si ipotizza che tutta la vernice prodotta venga venduta. Il prezzo di vendita per tonnellata è 3K\$ per E e 2K\$ per I. L'azienda ha effettuato un'indagine di mercato con i seguenti esiti:

- La domanda giornaliera di vernice I non super mai di più di 1 ton quella di vernice E.
- La domanda massima giornaliera di vernice I è di 2 ton.

Dati

- 3k\$ per E.
- 2k\$ per I.
- Disponibilità A 6 tonnellate.
- Disponibilità B 8 tonnellate.

Variabili

- x_E Tonnellate vernice E.
- x_I Tonnellate vernice I.

Obiettivo

- $\max 3x_E + 2x_I$

Vincoli

- $x_E + 2x_I \leq 6$
- $2x_E + x_I \leq 8$
- $x_I - x_E \leq 1$
- $x_I \leq 2$
- $x_E, x_I \geq 0$

2.4.2 Problema della dieta

Un determinato mangime per animali deve contenere in ogni dose almeno 2hg di proteine, 4hg di carboidrati e 3hg di grasso. Si possono miscelare 4 ingredienti con le seguenti caratteristiche (*in hg per ogni kg*).

Ingrediente	Proteine	Carboidrati	Grasso	Costo euro/kg
1	1	4	3	3
2	3	4	2	6
3	2	3	3	5
4	2	2	4	6

Problema Determinare quali ingredienti ed in quale quantità miscelare in modo da minimizzare il costo del mangime.

Dati

- Ogni dose deve contenere *almeno* 2hg di proteine, 4hg di carboidrati, 3hg di grasso.

Variabili

- x_j = quantità di ingredienti j in kg.

Obiettivo

- $\min \sum_{j=1}^4 c_j x_j \rightarrow$ minimizzare il costo.

Vincoli

- $\min 3x_1 + 6x_2 + 5x_3 + 6x_4$
- $x_1 + 3x_2 + 2x_3 + 2x_4 \geq 2hg$ proteine
- $4x_1 + 4x_2 + 3x_3 + 2x_4 \geq 4hg$ carboidrati
- $3x_1 + 2x_2 + 3x_3 + 4x_4 \geq 3hg$ grasso
- $x_j \geq 0 \quad j = 1 \dots 4$

2.5 Miscelazione

Due tipi di benzina si ottengono miscelando 3 tipi di materie grezze. Le due benzine sono vendute rispettivamente a 40 cent/l e a 30 cent/l. Le materie grezze sono vendute a 10 cent/l, 16 cent/l, 14 cent/l e sono disponibili in quantità giornaliere pari a 100000 l, 70000 l, 120000 l.

Problema Produrre benzina con le quantità di materie a disposizione.

Obiettivo Massimizzare il profitto tenendo conto del costo delle materie.

Dati

- $r_j \rightarrow$ ricavo benzina *j-esima*.
- $c_i \rightarrow$ costo petrolio *i-esimo*.
- $a_i \rightarrow$ quantità giornaliera di petrolio *i-esimo*.
- $\%_{ij}^{m/M} \rightarrow$ percentuale minima e massima di petrolio *i-esimo* da avere all'interno della benzina *j-esima*.

Variabili

- $p_{ij} =$ percentuale di petrolio *i* in benzina *j*.
- $b_j =$ litri di benzina *j-esima* prodotti.
- $p_i =$ litri di petrolio *i-esimo* usati.

- $x_{ij} := p_{ij}b_j \rightarrow$ litri di petrolio i -esimo usato per produrre i litri di benzina j -esima (ciò permette di ottenere un modello lineare).

Obiettivo

- $\max \left[\underbrace{\sum_{j=1}^n (\sum_{i=1}^m x_{ij}) r_j}_{\text{litri prodotti di benzina } j\text{-esima}} - \underbrace{\sum_{i=1}^m (\sum_{j=1}^n x_{ij}) c_i}_{\text{litri di petrolio } i\text{-esimo utilizzati}} \right] \rightarrow$ massimizzare il ricavo netto della produzione.

Vincoli

- $\sum_{j=1}^n x_{ij} \leq a_i \quad \forall i \rightarrow$ i litri di petrolio i -esimo utilizzati non possono superare i litri disponibili giornalmente.
- $\%_{ij}^m (\sum_{k=1}^m x_{kj}) \leq x_{ij} \leq \%_{ij}^M (\sum_{k=1}^m x_{kj}) \quad \forall i, j \rightarrow$ i litri di petrolio i -esimo all'interno della miscela per benzina j -esima deve essere compresa tra gli estremi di percentuale dati dalla tabella.
- $x_{ij} \geq 0 \quad \forall i, j$

2.6 Turnazione personale

Ci sono 3 turni lavorativi (mattina, pomeriggio, notte). Sono presenti n lavoratori che svolgono 5 turni settimanali, dopo un turno lavorativo per un lavoratore ce ne devono essere almeno 2 di riposo. Ogni lavoratore propone 5 turni in ordine di preferenza.

Problema Organizzare turni in modo tale che ognuno si coperto.

Obiettivo Minimizzare il grado di soddisfacibilità globale.

Dati

- $p_{gt}^j \rightarrow$ grado di soddisfacibilità del lavoratore j -esimo a lavorare il giorno g nel turno t .
- $r_{gt} \rightarrow$ numero lavoratori necessari il giorno g al turno t .

Variabili

- $x_{gt}^j = \begin{cases} 1 & \text{se il lavoratore } j\text{-esimo lavora il giorno } g \text{ al turno } t \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$

Obiettivo

- $\min \sum_{j=1}^n \sum_{g \in G} \sum_{t \in T} p_{gt}^j x_{gt}^j$

Vincoli

- $\sum_{j=1}^n x_{gt}^j \geq r_{gt} \quad \forall g, t \rightarrow$ per ogni turno giornaliero ci devono essere tanti lavoratori quanti sono richiesti.
- $\sum_{g \in G} \sum_{t \in T} x_{gt}^j \geq 5 \quad \forall j \rightarrow$ ogni lavoratore deve lavorare per almeno 5 turni.

•

$$\left. \begin{array}{l} x_{l,m}^j + x_{l,p}^j + x_{l,s}^j \leq 1 \\ x_{l,p}^j + x_{l,s}^j + x_{ma,m}^j \leq 1 \\ \dots \\ x_{d,m}^j + x_{d,p}^j + x_{d,s}^j \leq 1 \end{array} \right\} \forall j \rightarrow \text{ogni lavoratore deve avere almeno 2 turni di riposo dopo un turno di lavoro.}$$

2.7 Locazione di servizi

Abbiamo un insieme $N = \{1 \dots n\}$ di potenziali localizzazioni di servizi ed un insieme $I = \{1 \dots m\}$ di clienti. Ogni località j ha una capacità u_j e costo di attivazione c_j . Ogni cliente i ha una richiesta b_i . Il costo da sostenere per servire il cliente i dalla località j è h_{ij} e ogni cliente è servito da una sola località.

Problema Determinare la localizzazione di servizi così da soddisfare ogni cliente.

Obiettivo Minimizzare il costo di attivazione e di servizio complessivo.

Dati

- $u_j \rightarrow$ capacità località j -esima.
- $c_j \rightarrow$ costo attivazione località j -esima.
- $b_i \rightarrow$ richiesta cliente i -esimo.
- $h_{ij} \rightarrow$ costo per servire il cliente i dalla località j .

Variabili

- $y_j = \begin{cases} 1 & \text{se è attivo un servizio nella località } j\text{-esima} \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$
- $x_{ij} = \begin{cases} 1 & \text{se il cliente } i \text{ viene servito dalla località } j \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$

Obiettivo

- $\min[\sum_{j \in N} \sum_{i \in I} h_{ij} x_{ij} + \sum_{j \in N} c_j y_j] \rightarrow$ minimizzare il costo di attivazione di servizio tra i vari siti e clienti.

Vincoli

- $\sum_{j \in N} x_{ij} = 1 \quad \forall i \in I \rightarrow$ ogni cliente i è servito da una sola località j .
- $\sum_{i \in I} x_{ij} b_i \leq u_j \quad \forall j \in N \rightarrow$ ogni località j attiva deve soddisfare la domanda b_i del cliente i associato.
- $x_{ij} \leq y_j \quad \forall i \in I, j \in N$
- $x_{ij} \in \{0, 1\} \quad \forall i, j$
- $y_j \in \{0, 1\} \quad \forall j$

Gli ultimi 3 sono vincoli opzionali (ma non troppo). Il simplesso risolve il modello nel continuo, da cui tira poi fuori la soluzione intera.

2.8 Bin packing

Ci sono n oggetti, ciascuno con ingombro w_j . Sono dati dei contenitori di capacità b .

Problema Assegnare gli oggetti ai contenitori rispettando le capacità.

Obiettivo Minimizzare il numero di contenitori usati.

Dati

- $w_j \rightarrow$ ingombro oggetto j -esimo.
- b capacità contenitori.

Variabili

- $x_{ij} = \begin{cases} 1 & \text{se il contenitore } i\text{-esimo accetta l'oggetto } j\text{-esimo} \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$
- $y_i = \begin{cases} 1 & \text{se uso il contenitore } i\text{-esimo} \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$

Obiettivo

- $\min \sum_{i=1}^n y_i \rightarrow$ minimizzare il numero di contenitori usati.

Vincoli

- $\sum_{j=1}^n x_{ij} w_j \leq b y_i \quad \forall i \rightarrow$ tutti gli oggetti contenuti in ogni contenitore i -esimo non devono superare la capacità b .
- $\sum_{i=1}^n x_{ij} = 1 \quad \forall j \rightarrow$ ogni oggetto può essere messo in un unico contenitore.
- $x_{ij} \in \{0, 1\} \quad \forall i, j$
- $y_i \in \{0, 1\} \quad \forall i$

2.9 Problema di assegnamento

Ci sono m macchine identiche e n lavorazioni. Ogni lavorazione j richiede di essere processata da una qualsiasi delle m macchine per una durata ininterrotta p_j . Ogni macchina processa una sola lavorazione alla volta.

Problema Come assegnare le lavorazioni alle macchine.

Obiettivo Minimizzare l'istante di completamento della macchina che termina per ultima.

Dati

- $p_j \rightarrow$ durata della lavorazione j -esima.

Variabili

- $x_{ij} = \begin{cases} 1 & \text{se la macchina } i\text{-esima effettua la lavorazione } j \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$
- $T \geq 0 \rightarrow$ istante di completamento della macchina che termina per ultima.

Obiettivo

- $\min \max \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m x_{ij} p_j \rightarrow$ minimizzare l'istante di completamento della macchina che termina per ultima.

Vincoli

- $\sum_{j=1}^m x_{ij} p_j \leq T \quad \forall i \rightarrow$ ogni macchina termina le lavorazioni al più in contemporanea con la macchina che termina per ultima.
- $\sum_{i=1}^n x_{ij} = 1 \quad \forall j \rightarrow$ ogni lavorazione *i-esima* è effettuata da una e una sola macchina.
- $x_{ij} \in \{0, 1\} \quad \forall i, j$

2.10 Problema di sequenziamento monoprocesso

C'è una macchina e ci sono n lavorazioni. Ogni lavorazione j ha un tempo di processamento p_j , è disponibile a partire dall'istante r_j e deve essere completata entro la data d_j . La macchina può processare una sola lavorazione alla volta.

Problema In quale ordine processare le lavorazioni sulla macchina.

Obiettivo Minimizzare la somma degli istanti di completamento di tutte le lavorazioni.

Dati

- $p_j \rightarrow$ tempo di processamento della lavorazione *j-esima*.
- $r_j \rightarrow$ istante minimo di inizio della lavorazione *j-esima*.
- $d_j \rightarrow$ istante massimo di completamento della lavorazione *j-esima*.

Variabili

- $x_{ij} = \begin{cases} 1 & \text{se la lavorazione } i \text{ precede la lavorazione } j \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$
- $c_j =$ istante di completamento del lavoro *j-esimo*.

Obiettivo

- $\min \sum_{j=1}^n c_j \rightarrow$ minimizzare la somma degli istanti di completamento delle

lavorazioni.

Vincoli

- $c_j \leq c_k - p_k + M(1 - x_{jk}) \quad 1 \leq j < k \leq n \quad M \in R \rightarrow$ se j precede k , il suo istante di completamento al più coincide con quello di inizio di k .
- $c_k \leq c_j - p_j + Mx_{jk} \quad 1 \leq j < k \leq n \quad M \in R \rightarrow$ vincolo ridondante, poichè tiene conto del caso opposto (k precede j).
- $0 \leq p_j + r_j \leq c_j \leq d_j \quad \forall j = 1 \dots n \rightarrow$ l'istante minimo di fine processo j ($p_j + r_j$) al più coincide con il suo istante di completamento effettivo, ed al più coincide con l'istante massimo di completamento.
- $x_{jk} \in \{0, 1\} \quad 1 \leq j < k \leq n$

2.11 Problema di pianificazione della produzione

Determiniamo un piano di produzione di un prodotto specifico nell'arco di n periodi. Per ciascun periodo conosciamo la domanda da soddisfare d_t , il costo di produzione c_t e il costo di magazzino i_t per unità di prodotto. La capacità massima di produzione è c .

Problema Pianificare la produzione così da soddisfare la domanda per ogni periodo.

Obiettivo minimizzare i costi.

Dati

- $d_t \rightarrow$ domanda del periodo t -esimo.
- $c_t \rightarrow$ costo di produzione di un'unità nel periodo t -esimo.
- $i_t \rightarrow$ costo di magazzino di un unità nel periodo t -esimo.
- $c \rightarrow$ capacità massima di produzione.

Variabili

- $x_t =$ unità del prodotto nel periodo t -esimo.
- $m_t =$ unità del prodotto immagazzinate al termine del periodo t -esimo

Obiettivo

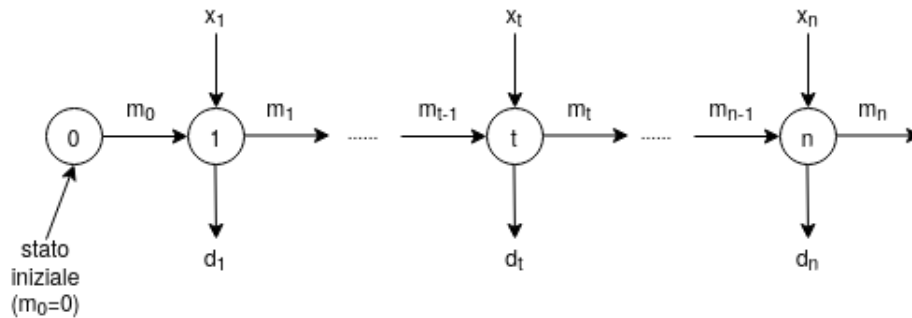
- $\min \sum_{t=1}^n c_t x_t + \sum_{t=1}^n i_t m_t \rightarrow$ minimizzare il costo di produzione e di magazzino.

Vincoli

- $m_{t-1} + x_t = d_t + m_t \quad t = 1 \dots n \rightarrow$ le unità immagazzinate dal periodo precedente insieme alle unità prodotte nel periodo t attuale devono coincidere con la domanda nel periodo t sommati ai prodotti rimanenti immagazzinati.
- $x_t \leq c \quad t = 1 \dots n \rightarrow$ le unità prodotte non possono superare la capacità produttiva.

Questo problema è rappresentabile tramite un **modello di flusso**:

Figure 1: Modello di flusso



A ogni periodo la produzione deve soddisfare la domanda (e non superare la capacità) e le unità rimaste vanno in magazzino.

2.11.1 Variante lotto minimo

Ogni periodo il lotto minimo è pari a L .

Variabili $y_t = \begin{cases} 1 & \text{se produco un lotto al periodo } t\text{-esimo} \\ 0 & \text{altrimenti} \end{cases}$

Vincoli

- $x_t \geq Ly_t \quad t = 1 \dots n$
- $x_t \leq cy_t \quad t = 1 \dots n$

2.11.2 Variante produzione con costi fissi

Se in un periodo è stata prodotta almeno una unità di prodotto si aggiunge un costo fisso k .

Obiettivo $\min \sum_{t=1}^n c_t x_t + \sum_{t=1}^n i_t m_t + \sum_{t=1}^n k y_c \rightarrow$ aggiungo il costo fisso nel caso in cui produco qualcosa.

2.11.3 Variante multiprodotto

Possono essere fabbricati più prodotti durante gli n periodi.

Variabili

- $x_t^j \rightarrow$ unità di prodotto j fabbricate nel periodo t .
- $m_t^j \rightarrow$ unità di prodotto j immagazzinate nel periodo t .

Obiettivo $\min \sum_j (\sum_{t=1}^n c_t^j x_t^j + \sum_{t=1}^n i_t^j m_t^j + \sum_{t=1}^n k y_t^j)$