

Analyse de sensibilité - Optimisation linéaire

Robinson Beaucour

Octobre 2022

1 Problème à résoudre

On cherche à minimiser le coût de production d'électricité sur une journée. Les données du problèmes sont ci-dessous.

Nom	Description	Type de variable
t	heure de la journée	indice
$X \in \{A, B, C\}$	type de centrale	indice
$n^{(X)}$	nombre de centrales de type X	constante
$C_{MWh}^{(X)}$	Coût de production d'un MWh par une centrale de type X	constante
$P_{max}^{(X)}$	La puissance maximale d'une centrale de type X	constante
$P_t^{(X)}$	La puissance totale des centrales de type X à l'heure t	variable de décision

Récapitulatif des variables du problème

Type	N	P_{max} (MW)	C_{MWh}
A	12	2000	1.50
B	10	1750	1.38
C	5	4000	2.75

Données des centrales du parc

Heure	0-5	6-8	9-14	15-17	18-23
Consommation(GW)	15	30	25	40	27

Données de consommation

On a le problème \mathcal{P} d'optimisation linéaire suivant:

$$\begin{aligned} & \underset{\forall t, \forall X, P_t^{(X)} \geq 0}{\text{minimize}} && \sum_{t=0}^{23} \sum_{X \in \{A, B, C\}} P_t^{(X)} \cdot C_{MWh}^{(X)} \\ & \text{subject to} && \begin{cases} \forall t \in \llbracket 0, 23 \rrbracket, \forall X \in \{A, B, C\}, & P_t^{(X)} \leq n^{(X)} P_{max}^{(X)} \\ \forall t \in \llbracket 0, 23 \rrbracket, & \sum_{X \in \{A, B, C\}} P_t^{(X)} \geq d_t \end{cases} \end{aligned}$$

On note $\mathcal{P}_{standard}$ un forme standard du problème \mathcal{P} défini par:

$$\begin{aligned} & \underset{P_t^{(X)} \geq 0, S_t^{(X)} \geq 0, S_t^{(d)} \geq 0}{\text{minimize}} && \sum_{t=0}^{23} \sum_{X \in \{A, B, C\}} P_t^{(X)} \cdot C_{MWh}^{(X)} \\ & \text{subject to} && \begin{cases} \forall t \in \llbracket 0, 23 \rrbracket, \forall X \in \{A, B, C\}, & P_t^{(X)} + S_t^{(X)} = n^{(X)} P_{max}^{(X)} \\ \forall t \in \llbracket 0, 23 \rrbracket, & \sum_{X \in \{A, B, C\}} P_t^{(X)} - S_t^{(d)} = d_t \end{cases} \end{aligned}$$

On pose $X \in \mathbb{R}^{24 \times 7}$, la matrice de blocs de taille 7×1 .

On pose $C \in \mathbb{R}^{24 \times 7}$, la matrice de blocs de taille 7×1 .

On pose $B \in \mathbb{R}^{24 \times 4}$, la matrice de blocs de taille 4×1 .

Dont les blocs sont définis par :

$$X_t = \begin{pmatrix} P_t^{(A)} \\ P_t^{(B)} \\ P_t^{(C)} \\ S_t^{(A)} \\ S_t^{(B)} \\ S_t^{(C)} \\ S_t^{(d)} \end{pmatrix}, C_t = \begin{pmatrix} C_{MW_h}^{(A)} \\ C_{MW_h}^{(B)} \\ C_{MW_h}^{(C)} \\ 0 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, B_t = \begin{pmatrix} P_{max}^{(A)} n^{(A)} \\ P_{max}^{(B)} n^{(B)} \\ P_{max}^{(C)} n^{(C)} \\ d_t \end{pmatrix},$$

Enfin on pose $A \in \mathbb{R}^{24 \times 28}$, la matrice bloc de taille 4×7 :

$$A_{t,t'} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 1 & 1 & 1 & 0 & 0 & 0 & -1 \end{pmatrix} \text{ si } t = t'$$

La matrice A est diagonale par bloc. $\mathcal{P}_{standard}$ peut maintenant s'écrire :

$$\begin{aligned} & \underset{X \geq 0}{\text{minimize}} \quad X \cdot C^\top \\ & \text{subject to} \quad A \cdot X = B \end{aligned}$$

2 Base optimale

— Rappel de cours —

Soit \mathcal{P} et sa forme standard $\mathcal{P}_{standard} : \min\{cx | Ax = B, x \geq 0\}$.
 β est une base optimale si et seulement si :

$$\begin{aligned} x_\beta &= A_\beta^{-1} b \geq 0, x_{\neg\beta} = 0 \\ u &= c_\beta^\top \\ \bar{c}^\top &= c^\top - u^\top A \geq 0 \end{aligned}$$

On note $\beta_t = (t+1, t+3, t+4, t+5)$ si $t \in \llbracket 0, 5 \rrbracket$, $\beta_t = (t, t+1, t+3, t+5)$ sinon. Nous allons montrer que $\beta = \bigcup_{t \in \llbracket 0, 23 \rrbracket} \beta_t$ est une base optimale de $\mathcal{P}_{standard}$.

On peut deviner la base grâce aux équivalences suivantes :

$$\begin{aligned} t \text{ appartient à la base} & \Leftrightarrow P_t^{(A)} \text{ est non nul}^* & \equiv \text{ Les centrales } A \text{ produisent à } t \\ t+1 \text{ appartient à la base} & \Leftrightarrow P_t^{(B)} \text{ est non nul}^* & \equiv \text{ Les centrales } B \text{ produisent à } t \\ t+2 \text{ appartient à la base} & \Leftrightarrow P_t^{(C)} \text{ est non nul}^* & \equiv \text{ Les centrales } C \text{ produisent à } t \\ t+3 \text{ appartient à la base} & \Leftrightarrow S_t^{(A)} \text{ est non nul}^* & \equiv \text{ Les centrales } A \text{ ne produisent pas au max possible à } t \\ t+4 \text{ appartient à la base} & \Leftrightarrow S_t^{(B)} \text{ est non nul}^* & \equiv \text{ Les centrales } B \text{ ne produisent pas au max possible à } t \\ t+5 \text{ appartient à la base} & \Leftrightarrow S_t^{(C)} \text{ est non nul}^* & \equiv \text{ Les centrales } C \text{ ne produisent pas au max possible à } t \\ t+6 \text{ appartient à la base} & \Leftrightarrow S_t^{(d)} \text{ est non nul}^* & \equiv \text{ Les centrales produisent plus que la demande à } t \end{aligned}$$

* Sauf si la solution est dégénérée.

On peut raisonner séparément pour chaque t car la matrice A est diagonale par bloc.

Pour $t \in \llbracket 0, 5 \rrbracket$,

$$A_{t|\beta} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 1 & 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, A_{t|\beta}^{-1} = \begin{pmatrix} 0 & -1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & -1 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}$$

On calcule :

$$X_{t|\beta} = \begin{pmatrix} d_t \\ n^{(A)}P_{max}^{(A)} \\ n^{(B)}P_{max}^{(B)} - d_t \\ n^{(C)}P_{max}^{(C)} \end{pmatrix} \geq 0, U_t = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \\ C_{MW_h}^{(B)} \end{pmatrix}, \bar{C}_t = \begin{pmatrix} 0 \\ C_{MW_h}^{(A)} - C_{MW_h}^{(B)} \\ C_{MW_h}^{(C)} - C_{MW_h}^{(B)} \\ 0 \\ 0 \\ 0 \\ C_{MW_h}^{(B)} \end{pmatrix} \geq 0$$

Pout $t \in \llbracket 5, 23 \rrbracket$,

$$A_{t|\beta} = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, A_{t|\beta}^{-1} = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & -1 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}$$

On calcule :

$$X_{t|\beta} = \begin{pmatrix} d_t - n^{(B)}P_{max}^{(B)} \\ n^{(B)}P_{max}^{(B)} \\ n^{(A)}P_{max}^{(A)} + n^{(B)}P_{max}^{(B)} - d_t \\ n^{(C)}P_{max}^{(C)} \end{pmatrix} \geq 0, U_t = \begin{pmatrix} 0 \\ C_{MW_h}^{(B)} - C_{MW_h}^{(A)} \\ 0 \\ C_{MW_h}^{(A)} \end{pmatrix}, \bar{C}_t = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ C_{MW_h}^{(C)} - C_{MW_h}^{(A)} \\ 0 \\ 0 \\ C_{MW_h}^{(A)} - C_{MW_h}^{(B)} \\ C_{MW_h}^{(A)} \end{pmatrix} \geq 0$$

On a vérifié que $X_\beta \geq 0, \bar{C} \geq 0$. β est une base optimale.

3 Analyse de sensibilité

3.1 Dégénérescence

Pour tout $t \in \llbracket 0, 23 \rrbracket$, $X_{t|\beta} > 0$. La base est donc non-dégénérée. Pour que la base soit dégénérée il suffit que une des coordonnées de X_β soit nulle :

Pour $t \in \llbracket 0, 5 \rrbracket$

$$\begin{aligned} d_t &= 0 & \text{ou} \\ n^{(A)}P_{max}^{(A)} &= 0 & \text{ou} \\ n^{(B)}P_{max}^{(B)} &= d_t & \text{ou} \\ n^{(C)}P_{max}^{(C)} &= 0 \end{aligned}$$

Pour $t \in \llbracket 6, 23 \rrbracket$

$$\begin{aligned} d_t &= n^{(B)}P_{max}^{(B)} & \text{ou} \\ n^{(A)}P_{max}^{(A)} &= 0 & \text{ou} \\ n^{(B)}P_{max}^{(B)} + n^{(A)}P_{max}^{(A)} &= d_t & \text{ou} \\ n^{(C)}P_{max}^{(C)} &= 0 \end{aligned}$$

On peut donc par exemple mettre d_t ou $n^{(C)}$ à 0. Mais aussi mettre $d_t = n^{(B)}P_{max}^{(B)}$.

3.2 Augmentation consommation

On suppose que la consommation augmente de $\delta_t \geq 0$. β reste optimale si $A_\beta^{-1}(b + \delta) \geq 0$, c'est à dire:

$$\begin{aligned} \forall t \in \llbracket 0, 5 \rrbracket, d_t + \delta_t &\leq n^{(B)}P_{max}^{(B)} \\ \forall t \in \llbracket 5, 23 \rrbracket, d_t + \delta_t &\leq n^{(B)}P_{max}^{(B)} + n^{(A)}P_{max}^{(A)} \end{aligned}$$

Si ces conditions sont respectées, le surcoût peut s'évaluer de cette manière:

$$\text{Surcoût} : u.\delta = \sum_{t \in \llbracket 0, 23 \rrbracket} U_t.(0, 0, 0, \delta_t) = \sum_{t \in \llbracket 0, 5 \rrbracket} C_{MW_h}^{(B)} \delta_t + \sum_{t \in \llbracket 6, 23 \rrbracket} C_{MW_h}^{(A)} \delta_t$$

Ce qui peut être résumé dans ce tableau:

Période	Surcoût 1 MW par heure	Surcoût max par heure
0-5	1.38	12420
6-8	1.5	17500
9-14	1.5	24750
15-17	1.5	2250
18-23	1.5	14500

3.3 Augmentation centrale B

Rien ne change sur la **période 1** si on ajoute une centrale $B.P_t^{(B)}$ reste égal à d_t

Rappel :

$$X_{t|\beta} = \begin{pmatrix} d_t \\ n^{(A)} P_{max}^{(A)} \\ n^{(B)} P_{max}^{(B)} - d_t \\ n^{(C)} P_{max}^{(C)} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 15 \\ 17.5 \\ 24 - 15 \\ 20 \end{pmatrix} \geq 0$$

Sur la **période 2**, le coût diminue par une augmentation de $P_t^{(B)}$ et une diminution de $P_t^{(A)}$. Après avoir vérifié que :

$$X_{t|\beta} = \begin{pmatrix} d_t - (n^{(B)} + 1) P_{max}^{(B)} \\ n^{(B)} P_{max}^{(B)} \\ n^{(A)} P_{max}^{(A)} + (n^{(B)} + 1) P_{max}^{(B)} - d_t \\ n^{(C)} P_{max}^{(C)} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 30 - 24 \\ 24 \\ 24 + 17.5 - 30 \\ 20 \end{pmatrix} \geq 0$$

On constate que $P_t^{(A)}$ passe de $d_t - n^{(B)} P_{max}^{(B)}$ à $d_t - (n^{(B)} + 1) P_{max}^{(B)}$. et que $P_t^{(B)}$ passe de $n^{(B)} P_{max}^{(B)}$ à $(n^{(B)} + 1) P_{max}^{(B)}$.

Le coût varie de $P_{max}^{(B)} \cdot (C_{MW_h}^{(B)} - C_{MW_h}^{(A)})$ soit 240 d'économies par heure.

3.4 Diminution Centrale B

Rien ne change sur la **période 1** si on retire une centrale $B.P_t^{(B)}$ reste égal à d_t car :

$$X_{t|\beta} = \begin{pmatrix} d_t \\ n^{(A)} P_{max}^{(A)} \\ (n^{(B)} - 1) P_{max}^{(B)} - d_t \\ n^{(C)} P_{max}^{(C)} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 15 \\ 17.5 \\ 24 - 2 - 15 \\ 20 \end{pmatrix} \geq 0$$

Sur la **période 2**, le coût diminue par une diminution de $P_t^{(B)}$ et une augmentation de $P_t^{(A)}$. Après avoir vérifié que :

$$X_{t|\beta} = \begin{pmatrix} d_t - (n^{(B)} - 1) P_{max}^{(B)} \\ n^{(B)} P_{max}^{(B)} \\ n^{(A)} P_{max}^{(A)} + (n^{(B)} - 1) P_{max}^{(B)} - d_t \\ n^{(C)} P_{max}^{(C)} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 30 - 24 - 2 \\ 24 \\ 17.5 + 24 - 30 \\ 20 \end{pmatrix} \geq 0$$

En revanche, sur la **période 3**, la perte de la centrale B rend la base β non optimale car on a :

$$n^{(A)} P_{max}^{(A)} + (n^{(B)} - 1) P_{max}^{(B)} - d_t = 39.5 - 40 < 0$$

3.5 Diminution coût centrale C

Si le coût du MWh des centrales C diminue de 1, la base reste optimale si le coût réduit \bar{C} reste positif. Vérifions :

$$\begin{aligned} \forall t \in \llbracket 0, 5 \rrbracket, \bar{C}_t &= \begin{pmatrix} 0 \\ C_{MW_h}^{(A)} - C_{MW_h}^{(B)} \\ C_{MW_h}^{(C)} - 1 - C_{MW_h}^{(B)} \\ 0 \\ 0 \\ 0 \\ C_{MW_h}^{(B)} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 1.50 - 1.38 \\ 2.75 - 1.38 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \\ 1.38 \end{pmatrix} \geq 0 \\ \forall t \in \llbracket 6, 23 \rrbracket, \bar{C}_t &= \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ C_{MW_h}^{(C)} - 1 - C_{MW_h}^{(A)} \\ 0 \\ 0 \\ C_{MW_h}^{(A)} - C_{MW_h}^{(B)} \\ C_{MW_h}^{(A)} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 2.75 - 1 - 1.50 \\ 0 \\ 0 \\ 1.50 - 1.38 \\ 1.50 \end{pmatrix} \geq 0 \end{aligned}$$

D'après la description de \bar{C} , Si $C_{MW_h}^{(B)}$ diminue alors \bar{C} reste positif. Ce qui prouve que la base reste optimale.

Le coût du MWh par B peut augmenter jusqu'à 1.50 ($= C_{MW_h}^{(A)}$) la base β restera optimale car on conservera $\bar{C} \geq 0$.