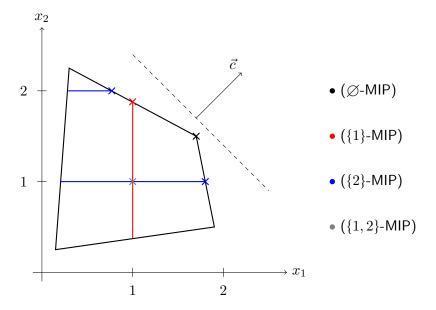
Abstände optimaler Lösungen gemischt-ganzzahliger Programme

Seminar zur Optimierung und Spieltheorie Insitut für Mathematik der Universität Augsburg Diskrete Mathematik, Optimierung und Operations Research

Michael Markl 08. November 2018



Gliederung

- 1. Problemdefinition und wichtige Größen
 - 1.1 Einfache Folgerung aus Theorem von Cook
- 2. Abschätzung mit Anzahl ganzzahliger Variablen
 - 2.1 Beweis der Abschätzung
 - 2.2 Folgerungen aus Theorie endlicher Gruppen
- 3. Ergebnisse für lineare Abschätzung

Problemdefinition und wichtige Größen

Definition (Gemischt-ganzzahliges lineares Programm)

Für $A\in\mathbb{Z}^{n\times m}$, $b\in\mathbb{Z}^m$, $c\in\mathbb{R}^n$ und $I\subseteq[n]:=\{1,\ldots,n\}$ bezeichne (I-MIP) das Programm

s.t.
$$\max_{Ax \leqslant b} c^{\mathsf{T}}x$$

 $\forall i \in I : x_i \in \mathbb{Z}$.

Definition (Gemischt-ganzzahliges lineares Programm)

Für $A \in \mathbb{Z}^{n \times m}$, $b \in \mathbb{Z}^m$, $c \in \mathbb{R}^n$ und $I \subseteq [n] := \{1, \dots, n\}$ bezeichne (I-MIP) das Programm

$$\mathbf{s.t.} \quad \begin{aligned} \max c^\intercal x \\ Ax \leqslant b \\ \forall i \in I : x_i \in \mathbb{Z} \end{aligned}.$$

Mit $\Delta(A) := \max\{|\det(Q)| \mid Q \text{ quadratische Untermatrix von } A\}$ formulieren wir folgende Vermutung:

Definition (Gemischt-ganzzahliges lineares Programm)

Für $A \in \mathbb{Z}^{n \times m}$, $b \in \mathbb{Z}^m$, $c \in \mathbb{R}^n$ und $I \subseteq [n] := \{1, \dots, n\}$ bezeichne (I-MIP) das Programm

$$\mathbf{s.t.} \quad \begin{aligned} \max c^\intercal x \\ Ax \leqslant b \\ \forall i \in I : x_i \in \mathbb{Z} \end{aligned}.$$

 $\mbox{Mit } \Delta(A) := \max\{|\det(Q)| \mid Q \mbox{ quadratische Untermatrix von } A\} \mbox{ formulieren wir folgende Vermutung:}$

Vermutung 1.1

Es gibt eine Funktion $f: \mathbb{N} \to \mathbb{R}$, sodass für alle $I, J \subseteq [n]$ gilt: Besitzt (J-MIP) eine Optimallösung, so existiert für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $\|x^* - y^*\|_{\infty} \leq f(\Delta)$.

Theorem von Cook

Theorem 2.1 (Cook u. a., 1986)

Seien $I, J \subseteq [n]$ mit $I = \emptyset$ oder $J = \emptyset$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung hat.

Dann existiert für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $||x^* - y^*||_{\infty} \leq n\Delta$.

Theorem von Cook

Theorem 2.1 (Cook u. a., 1986)

Seien $I, J \subseteq [n]$ mit $I = \emptyset$ oder $J = \emptyset$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung hat.

Dann existiert für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $\|x^* - y^*\|_{\infty} \leq n\Delta$.

Korollar 2.2

Seien $I,J\subseteq [n]$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung hat. Dann existiert für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $\|x^*-y^*\|_{\infty}\leqslant 2n\Delta$.

Theorem von Cook

Theorem 2.1 (Cook u. a., 1986)

Seien $I, J \subseteq [n]$ mit $I = \emptyset$ oder $J = \emptyset$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung hat.

Dann existiert für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $\|x^* - y^*\|_{\infty} \leq n\Delta$.

Korollar 2.2

Seien $I, J \subseteq [n]$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung hat. Dann existiert für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $\|x^* - y^*\|_{\infty} \leq 2n\Delta$.

Wir wollen in dieser Abschätzung 2n durch $|I \cup J|$ ersetzen.

Abschätzung mit Anzahl ganzzahliger Variablen

Lemma 2.9

Seien
$$u^i \in \mathbb{Z}^d$$
, $\lambda_i \geqslant 0$ für $i \in [k]$ gegeben. Dann existiert $\gamma \in \times_{i=1}^k [0,\lambda_i]$ mit $\sum_{i=1}^k \gamma_i u^i \in \mathbb{Z}^d$ und $\sum_{i=1}^k (\lambda_i - \gamma_i) < d$.

Lemma 2.9

Seien $u^i \in \mathbb{Z}^d$, $\lambda_i \geqslant 0$ für $i \in [k]$ gegeben. Dann existiert $\gamma \in \times_{i=1}^k [0, \lambda_i] \text{ mit } \sum_{i=1}^k \gamma_i u^i \in \mathbb{Z}^d \text{ und } \sum_{i=1}^k (\lambda_i - \gamma_i) < d.$

Lemma 2.10

Sei $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ gegeben. Der Polyeder $C := \{x \in \mathbb{R}^n \mid Ax \leq 0\}$ besitzt die Darstellung $C = \{\sum_{i=1}^k \lambda_i v^i \mid \forall i \in [k] : \lambda_i \geqslant 0\}$ mit $v^i \in \mathbb{Z}^n$ und $||v^i||_{\infty} \leq \Delta(A)$ für $i \in [k]$.

Lemma 2.9

Seien $u^i \in \mathbb{Z}^d$, $\lambda_i \geqslant 0$ für $i \in [k]$ gegeben. Dann existiert $\gamma \in \times_{i=1}^k [0, \lambda_i]$ mit $\sum_{i=1}^k \gamma_i u^i \in \mathbb{Z}^d$ und $\sum_{i=1}^k (\lambda_i - \gamma_i) < d$.

Lemma 2.10

Sei $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$ gegeben. Der Polyeder $C := \{x \in \mathbb{R}^n \mid Ax \leqslant 0\}$ besitzt die Darstellung $C = \{\sum_{i=1}^k \lambda_i v^i \mid \forall i \in [k] \colon \lambda_i \geqslant 0\}$ mit $v^i \in \mathbb{Z}^n$ und $\|v^i\|_{\infty} \leqslant \Delta(A)$ für $i \in [k]$.

Theorem 2.11

Seien $I,J\subseteq [n]$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung \tilde{y} hat. Für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) existiert eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $\|x^*-y^*\|_{\infty} \leqslant |I\cup J|\cdot \Delta$.

Theorem 2.11

Seien $I, J \subseteq [n]$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung \tilde{y} hat. Für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) existiert eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $||x^* - y^*||_{\infty} \leq |I \cup J| \cdot \Delta$.

Theorem 2.11

Seien $I, J \subseteq [n]$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung \tilde{y} hat. Für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) existiert eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $||x^* - y^*||_{\infty} \leq |I \cup J| \cdot \Delta$.

$$A_1 y^* = A_1 x^* + \sum_{i=1}^k (\lambda_i - \gamma_i) A_1 v^i \leqslant A_1 x^* \leqslant b_1$$

Theorem 2.11

Seien $I, J \subseteq [n]$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung \tilde{y} hat. Für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) existiert eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $||x^* - y^*||_{\infty} \leq |I \cup J| \cdot \Delta$.

$$\begin{array}{rclcrcl} A_1 y^* & = & A_1 x^* + \sum_{i=1}^k (\lambda_i - \gamma_i) A_1 v^i & \leqslant & A_1 x^* & \leqslant & b_1 \\ A_2 y^* & = & A_2 \tilde{y} - \sum_{i=1}^k \gamma_i A_2 v^i & \leqslant & A_2 \tilde{y} & \leqslant & b_2 \end{array}$$

Theorem 2.11

Seien $I, J \subseteq [n]$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung \tilde{y} hat. Für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) existiert eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $||x^* - y^*||_{\infty} \leq |I \cup J| \cdot \Delta$.

$$\begin{array}{rclcrcl} A_1 y^* & = & A_1 x^* + \sum_{i=1}^k (\lambda_i - \gamma_i) A_1 v^i & \leqslant & A_1 x^* & \leqslant & b_1 \\ A_2 y^* & = & A_2 \tilde{y} - \sum_{i=1}^k \gamma_i A_2 v^i & \leqslant & A_2 \tilde{y} & \leqslant & b_2 \\ A_1 \tilde{x} & = & A_1 x^* + \sum_{i=1}^k \gamma_i A_1 v^i & \leqslant & A_1 x^* & \leqslant & b_1 \end{array}$$

Theorem 2.11

Seien $I, J \subseteq [n]$, sodass (J-MIP) eine Optimallösung \tilde{y} hat. Für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) existiert eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $||x^* - y^*||_{\infty} \leq |I \cup J| \cdot \Delta$.

$$\begin{array}{lclcrcl} A_1 y^* & = & A_1 x^* + \sum_{i=1}^k (\lambda_i - \gamma_i) A_1 v^i & \leqslant & A_1 x^* & \leqslant & b_1 \\ A_2 y^* & = & A_2 \tilde{y} - \sum_{i=1}^k \gamma_i A_2 v^i & \leqslant & A_2 \tilde{y} & \leqslant & b_2 \\ A_1 \tilde{x} & = & A_1 x^* + \sum_{i=1}^k \gamma_i A_1 v^i & \leqslant & A_1 x^* & \leqslant & b_1 \\ A_2 \tilde{x} & = & A_2 \tilde{y} - \sum_{i=1}^k (\lambda_i - \gamma_i) A_2 v^i & \leqslant & A_2 \tilde{y} & \leqslant & b_2. \end{array}$$

Das Theorem von Olson

Definition 2.3 (Davenport-Konstante)

Sei (G,+,0) eine endliche, abelsche Gruppe. Die Davenport-Konstante D(G) ist die kleinste Zahl $k\in\mathbb{N}$ mit

$$\forall g^1, \dots, g^k \in G \ \exists I \subseteq [k] \colon I \neq \emptyset \land \sum_{i \in I} g^i = 0.$$

Theorem 2.6 (Olson, 1969)

Die Davenport-Konstante von $\mathbb{Z}^d/p\mathbb{Z}^d$ ist 1+dp-d für p prim.

Das Theorem von Olson

Definition 2.3 (Davenport-Konstante)

Sei (G,+,0) eine endliche, abelsche Gruppe. Die Davenport-Konstante D(G) ist die kleinste Zahl $k\in\mathbb{N}$ mit

$$\forall g^1, \dots, g^k \in G \ \exists I \subseteq [k] \colon I \neq \emptyset \land \sum_{i \in I} g^i = 0.$$

Theorem 2.6 (Olson, 1969)

Die Davenport-Konstante von $\mathbb{Z}^d/p\mathbb{Z}^d$ ist 1+dp-d für p prim.

Korollar 2.7

Seien $p \in \mathbb{N}$ eine Primzahl, $d \in \mathbb{N}$ und $f^1, \dots, f^r \in \mathbb{Z}^d$ mit $r \geqslant 1 + dp - d$ gegeben.

Dann existiert eine nicht-leere Menge $I \subseteq [r]$ mit $\sum_{i \in I} f^i \in p\mathbb{Z}^d$.

Beweis des Hilflemmas

Korollar 2.7

Seien $p \in \mathbb{N}$ eine Primzahl, $d \in \mathbb{N}$ und $f^1, \dots, f^r \in \mathbb{Z}^d$ mit $r \geqslant 1 + dp - d$ gegeben.

Dann existiert eine nicht-leere Menge $I \subseteq [r]$ mit $\sum_{i \in I} f^i \in p\mathbb{Z}^d$.

Lemma 2.8

Seien $d, k \in \mathbb{N}, u^1, \dots, u^k \in \mathbb{Z}^d$ und $\alpha_1, \dots, \alpha_k \ge 0$ mit $\sum_{i=1}^k \alpha_i \ge d$.

Dann existiert $\beta \in \times_{i=1}^k [0, \alpha_i]$ mit $\beta \neq 0$ und $\sum_{i=1}^k \beta_i u^i \in \mathbb{Z}^d$.

Beweis des Hilflemmas

Korollar 2.7

Seien $p \in \mathbb{N}$ eine Primzahl, $d \in \mathbb{N}$ und $f^1, \dots, f^r \in \mathbb{Z}^d$ mit $r \geqslant 1 + dp - d$ gegeben.

Dann existiert eine nicht-leere Menge $I \subseteq [r]$ mit $\sum_{i \in I} f^i \in p\mathbb{Z}^d$.

Lemma 2.8

Seien $d, k \in \mathbb{N}, u^1, \dots, u^k \in \mathbb{Z}^d$ und $\alpha_1, \dots, \alpha_k \ge 0$ mit $\sum_{i=1}^k \alpha_i \ge d$.

Dann existiert $\beta \in \times_{i=1}^k [0, \alpha_i]$ mit $\beta \neq 0$ und $\sum_{i=1}^k \beta_i u^i \in \mathbb{Z}^d$.

Lemma 2.9

Seien $u^i \in \mathbb{Z}^d$, $\lambda_i \geqslant 0$ für $i \in [k]$ gegeben. Dann existiert $\gamma \in \times_{i=1}^k [0, \lambda_i]$ mit $\sum_{i=1}^k \gamma_i u^i \in \mathbb{Z}^d$ und $\sum_{i=1}^k (\lambda_i - \gamma_i) < d$.

Ergebnisse für lineare Abschätzung

Angenommen, es gäbe ein f wie in der Vermutung, das den Abstand nur in Abhängigkeit von Δ beschränkt.

Beispiel 3.1

Für $\delta \in \mathbb{N}$ seien

$$A := \begin{pmatrix} -\delta & 0 \\ \delta & -1 \end{pmatrix}, \quad b := \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \end{pmatrix}, \quad c^{\mathsf{T}} := (0, -1).$$

Angenommen, es gäbe ein f wie in der Vermutung, das den Abstand nur in Abhängigkeit von Δ beschränkt.

Beispiel 3.1

Für $\delta \in \mathbb{N}$ seien

$$A := \begin{pmatrix} -\delta & 0 \\ \delta & -1 \end{pmatrix}, \quad b := \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \end{pmatrix}, \quad c^{\mathsf{T}} := (0, -1).$$

Es wird x_2 minimiert unter den Nebenbedingungen $1 \le \delta x_1 \le x_2$.

Angenommen, es gäbe ein f wie in der Vermutung, das den Abstand nur in Abhängigkeit von Δ beschränkt.

Beispiel 3.1

Für $\delta \in \mathbb{N}$ seien

$$A := \begin{pmatrix} -\delta & 0 \\ \delta & -1 \end{pmatrix}, \quad b := \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \end{pmatrix}, \quad c^{\mathsf{T}} := (0, -1).$$

Es wird x_2 minimiert unter den Nebenbedingungen $1 \le \delta x_1 \le x_2$. Es gilt $\Delta = \delta$ und $x^* = (1/\delta, 1)$ ist Optimallösung von (\varnothing -MIP) und ($\{2\}$ -MIP).

Angenommen, es gäbe ein f wie in der Vermutung, das den Abstand nur in Abhängigkeit von Δ beschränkt.

Beispiel 3.1

Für $\delta \in \mathbb{N}$ seien

$$A := \begin{pmatrix} -\delta & 0 \\ \delta & -1 \end{pmatrix}, \quad b := \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \end{pmatrix}, \quad c^{\mathsf{T}} := (0, -1).$$

Es wird x_2 minimiert unter den Nebenbedingungen $1 \le \delta x_1 \le x_2$. Es gilt $\Delta = \delta$ und $x^* = (1/\delta, 1)$ ist Optimallösung von (\varnothing -MIP) und ($\{2\}$ -MIP).

Die Optimallösung von ({1}-MIP) und ({1,2}-MIP) ist $y^*=(1,\delta)$.

Angenommen, es gäbe ein f wie in der Vermutung, das den Abstand nur in Abhängigkeit von Δ beschränkt.

Beispiel 3.1

Für $\delta \in \mathbb{N}$ seien

$$A := \begin{pmatrix} -\delta & 0 \\ \delta & -1 \end{pmatrix}, \quad b := \begin{pmatrix} -1 \\ 0 \end{pmatrix}, \quad c^{\mathsf{T}} := (0, -1).$$

Es wird x_2 minimiert unter den Nebenbedingungen $1 \le \delta x_1 \le x_2$. Es gilt $\Delta = \delta$ und $x^* = (1/\delta, 1)$ ist Optimallösung von (\varnothing -MIP) und ($\{2\}$ -MIP).

Die Optimallösung von ({1}-MIP) und ({1,2}-MIP) ist $y^*=(1,\delta)$. $\|x^*-y^*\|_{\infty}=\delta-1=\Omega(\Delta)$.

Abschätzung nur mit Δ

Lemma 3.3 (Veselov-Chirkov, 2009)

```
Seien A \in \mathbb{Z}^{m \times n}, b \in \mathbb{Z}^m mit \operatorname{rang}(A) = n, und jede n \times n

Teilmatrix \tilde{A} von A erfülle |\det(\tilde{A})| \leq 2.

Sei z eine Ecke von P := \{x \in \mathbb{R}^n \mid Ax \leq b\}. Mit Q := \operatorname{co}(\{x \in \mathbb{Z}^n \mid A_{\operatorname{eq}(z)}x \leq b_{\operatorname{eq}(z)}\}) gelten:
```

- (a) Jede Ecke von Q liegt auf einer Kante von P, die z enthält.
- (b) Jede Kante von P, die z und einen ganzzahligen Punkt enthält, enthält auch einen ganzzahligen Punkt y mit $||z-y||_{\infty} \le 1$.

Abschätzung nur mit Δ

Lemma 3.3 (Veselov-Chirkov, 2009)

Seien $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$, $b \in \mathbb{Z}^m$ mit $\operatorname{rang}(A) = n$, und jede $n \times n$ Teilmatrix \tilde{A} von A erfülle $|\det(\tilde{A})| \leq 2$. Sei z eine Ecke von $P := \{x \in \mathbb{R}^n \mid Ax \leq b\}$. Mit $Q := \operatorname{co}(\{x \in \mathbb{Z}^n \mid A_{\operatorname{eq}(z)}x \leq b_{\operatorname{eq}(z)}\})$ gelten:

- (a) Jede Ecke von Q liegt auf einer Kante von P, die z enthält.
- (b) Jede Kante von P, die z und einen ganzzahligen Punkt enthält, enthält auch einen ganzzahligen Punkt y mit $||z-y||_{\infty} \leq 1$.

Theorem 3.9

Seien $\Delta \leqslant 2$ und $I, J \in \{\emptyset, [n]\}$, sodass eine Optimallösung von (J-MIP) existiert.

Für jede Optimallösung x^* von (I-MIP) existiert eine Optimallösung y^* von (J-MIP) mit $\|x^* - y^*\|_{\infty} \leq \Delta$.

Literatur I

```
Sensitivity theorems in integer linear programming.
          In: Mathematical Programming 34 (1986), Apr. Nr. 3, 251–264.
          http://dx.doi.org/10.1007/BF01582230.-
          DOI 10.1007/BF01582230. -
          ISSN 1436-4646
[Ols69]
          OLSON, John E.:
          A combinatorial problem on finite Abelian groups, I.
          In: Journal of Number Theory 1 (1969), Nr. 1, 8 - 10.
          http://dx.doi.org/10.1016/0022-314X(69)90021-3. -
          DOI 10.1016/0022-314X(69)90021-3. -
          ISSN 0022-314X
[PWW18] PAAT. Joseph: WEISMANTEL. Robert: WELTGE. Stefan:
          Distances between optimal solutions of mixed-integer programs.
          In: Mathematical Programming (2018), Aug.
          http://dx.doi.org/10.1007/s10107-018-1323-z.-
          DOI 10.1007/s10107-018-1323-z. -
          ISSN 1436-4646
```

[CGST86] COOK, W.; GERARDS, A. M. H.; SCHRIJVER, A.; TARDOS, É.:

Literatur II

[Sch86]

Theory of Linear and Integer Programming.

New York, NY, USA: John Wiley & Sons, Inc., 1986. – ISBN 0-471-90854-1

[VC09] VESELOV, S.I.; CHIRKOV, A.J.:
Integer program with bimodular matrix.
In: Discrete Optimization 6 (2009), Nr. 2, 220 - 222.

http://dx.doi.org/10.1016/j.disopt.2008.12.002. –
DOI 10.1016/j.disopt.2008.12.002. –
ISSN 1572-5286

SCHRIJVER. Alexander: