

Optimisation linéaire

Romain DUJOL, Jean-Paul FOREST

CY TECH – ING1-IN



2022 – 2023

Problème d'optimisation linéaire en nombres entiers

Introduction sur un exemple

Définition

Méthode des coupes

Principe

Disposition pratique

Problème d'optimisation linéaire en nombres entiers

Problème d'optimisation linéaire en nombres entiers

Introduction sur un exemple

Formulation du problème

Un grossiste propose deux types de bière blonde par fût de douze litres à destination des débits de boisson, une version « light » et une version normale :

- ▶ la version « light » nécessite 10 litres de bière blonde;
- ▶ la version normale nécessite 12 litres de bière blonde;

L'approvisionnement du grossiste est limité : 59 litres de bière blonde.

Le grossiste cherche à répartir sa production de manière à obtenir un bénéfice maximal sachant qu'il réalise 10€ de bénéfice par fût de bière blonde « light » et 11€ de bénéfice par fût de bière blonde normale.

(On fait l'hypothèse que tout fût produit est vendu.)

(On fait l'hypothèse que la conception des fûts imposent que ceux-ci doivent être vendus pleins.)

Formulation complète

Formulation complète

- x_1 : nombre de fûts de bière blonde « light » produits;

Formulation complète

- ▶ x_1 : nombre de fûts de bière blonde « light » produits;
- ▶ x_2 : nombre de fûts de bière blonde normale produits.

Formulation complète

- ▶ x_1 : nombre de fûts de bière blonde « light » produits;
- ▶ x_2 : nombre de fûts de bière blonde normale produits.

$$(\bar{P}) \left\{ \begin{array}{l} \max (10x_1 + 11x_2) \\ 10x_1 + 12x_2 \leq 59 \\ x_1, \quad x_2 \geq 0 \end{array} \right.$$

Formulation complète

- ▶ x_1 : nombre de fûts de bière blonde « light » produits;
- ▶ x_2 : nombre de fûts de bière blonde normale produits.

$$(P) \begin{cases} \max & (10x_1 + 11x_2) \\ & 10x_1 + 12x_2 \leq 59 \\ & x_1, x_2 \in \mathbb{N} \end{cases}$$

Formulation complète

- ▶ x_1 : nombre de fûts de bière blonde « light » produits;
- ▶ x_2 : nombre de fûts de bière blonde normale produits.

$$(P) \begin{cases} \max & (10x_1 + 11x_2) \\ & 10x_1 + 12x_2 \leq 59 \\ & x_1, x_2 \in \mathbb{N} \end{cases}$$

Résolution par méthode des tableaux

Formulation complète

- ▶ x_1 : nombre de fûts de bière blonde « light » produits;
- ▶ x_2 : nombre de fûts de bière blonde normale produits.

$$(P) \begin{cases} \max & (10x_1 + 11x_2) \\ & 10x_1 + 12x_2 \leq 59 \\ & x_1, x_2 \in \mathbb{N} \end{cases}$$

Résolution par méthode des tableaux

Tableau final :

f	x_1	x_2	y_1	
	0	-1	-1	-59
x_1	1	12/10	1/10	59/10

Formulation complète

- ▶ x_1 : nombre de fûts de bière blonde « light » produits;
- ▶ x_2 : nombre de fûts de bière blonde normale produits.

$$(P) \begin{cases} \max & (10x_1 + 11x_2) \\ & 10x_1 + 12x_2 \leq 59 \\ & x_1, x_2 \in \mathbb{N} \end{cases}$$

Résolution par méthode des tableaux

Tableau final :

f	x_1	x_2	y_1	
0	1	-1	-1	-59
x_1	1	12/10	1/10	59/10

$$\Rightarrow x_1^* = \frac{59}{10} \notin \mathbb{N} \text{ et } x_2^* = 0$$

Problème d'optimisation linéaire en nombres entiers

Définition

Problème d'optimisation linéaire en nombres entiers

Définition (Problème en nombres entiers)

Un problème d'optimisation linéaire est dit **en nombres entiers** si et seulement si toutes les variables sont entières.

$$(P) \begin{cases} \max_x (c|x) \\ Ax \leq b, x \in \mathbb{N}^n \end{cases}$$

Problème d'optimisation linéaire en nombres entiers

Définition (Problème en nombres entiers)

Un problème d'optimisation linéaire est dit **en nombres entiers** si et seulement si toutes les variables sont **entières**.

$$(P) \begin{cases} \max_x (c|x) \\ Ax \leq b, x \in \mathbb{N}^n \end{cases}$$

Problème d'optimisation linéaire en nombres entiers

Définition (Problème en nombres entiers)

Un problème d'optimisation linéaire est dit **en nombres entiers** si et seulement si toutes les variables sont entières.

$$(P) \begin{cases} \max_x (c|x) \\ Ax \leq b, x \in \mathbb{N}^n \end{cases}$$

Définition (Problème relaxé)

Le **problème relaxé** de (P) $\begin{cases} \max_x (c|x) \\ Ax \leq b, x \in \mathbb{N}^n \end{cases}$ est le

problème d'optimisation linéaire $(\bar{P}) \begin{cases} \max_x (c|x) \\ Ax \leq b, x \geq 0 \end{cases}$

Méthode des coupes

Méthode des coupes

Principe

Idée fondamentale

Rajouter des contraintes (« coupes ») de manière à ce que l'optimum du problème relaxé soit entier.

Idée fondamentale

Rajouter des contraintes (« coupes ») de manière à ce que l'optimum du problème relaxé soit entier.

Principe de l'algorithme

Idée fondamentale

Rajouter des contraintes (« coupes ») de manière à ce que l'optimum du problème relaxé soit entier.

Principe de l'algorithme

1. On part de l'optimum du problème relaxé.

Idée fondamentale

Rajouter des contraintes (« coupes ») de manière à ce que l'optimum du problème relaxé soit entier.

Principe de l'algorithme

1. On part de l'optimum du problème relaxé.
2. Si l'optimum courant n'est pas entier :

Idée fondamentale

Rajouter des contraintes (« coupes ») de manière à ce que l'optimum du problème relaxé soit entier.

Principe de l'algorithme

1. On part de l'optimum du problème relaxé.
2. Si l'optimum courant n'est pas entier :
 - ▶ choisir une variable non entière;

Idée fondamentale

Rajouter des contraintes (« coupes ») de manière à ce que l'optimum du problème relaxé soit entier.

Principe de l'algorithme

1. On part de l'optimum du problème relaxé.
2. Si l'optimum courant n'est pas entier :
 - ▶ choisir une variable non entière;
 - ▶ construire une nouvelle contrainte à partir de cette variable;

Idée fondamentale

Rajouter des contraintes (« coupes ») de manière à ce que l'optimum du problème relaxé soit entier.

Principe de l'algorithme

1. On part de l'optimum du problème relaxé.
2. Si l'optimum courant n'est pas entier :
 - ▶ choisir une variable non entière;
 - ▶ construire une nouvelle contrainte à partir de cette variable;
 - ▶ calculer l'optimum du nouveau problème
(\rightsquigarrow méthode « primale-duale »).

Idée fondamentale

Rajouter des contraintes (« coupes ») de manière à ce que l'optimum du problème relaxé soit entier.

Principe de l'algorithme

1. On part de l'optimum du problème relaxé.
2. Si l'optimum courant n'est pas entier :
 - ▶ choisir une variable non entière;
 - ▶ construire une nouvelle contrainte à partir de cette variable;
 - ▶ calculer l'optimum du nouveau problème
(\rightsquigarrow méthode « primale-duale »).
3. Si l'optimum courant est entier, on s'arrête.
Sinon, on revient en 2.

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, [x] = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor =$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor =$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie fractionnaire)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} = x - \lfloor x \rfloor$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie fractionnaire)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} = x - \lfloor x \rfloor$$

Exemples

$$\{2,4\} =$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie fractionnaire)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} = x - \lfloor x \rfloor$$

Exemples

$$\{2,4\} = 0,4$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie fractionnaire)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} = x - \lfloor x \rfloor$$

Exemples

$$\{2,4\} = 0,4$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie fractionnaire)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} = x - \lfloor x \rfloor$$

Exemples

$$\{2,4\} = 0,4 \quad \{-2,4\} =$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie fractionnaire)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} = x - \lfloor x \rfloor$$

Exemples

$$\{2,4\} = 0,4 \quad \{-2,4\} = 0,6$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie fractionnaire)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} = x - \lfloor x \rfloor$$

Exemples

$$\{2,4\} = 0,4 \quad \{-2,4\} = 0,6$$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie fractionnaire)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} = x - \lfloor x \rfloor$$

Exemples

$$\{2,4\} = 0,4 \quad \{-2,4\} = 0,6$$

Propriété $\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor \leq x < \lfloor x \rfloor + 1$

Définition (Partie entière)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor = \max\{n \in \mathbb{Z}, n \leq x\}$$

Exemples

$$\lfloor 2,4 \rfloor = 2 \quad \lfloor -2,4 \rfloor = -3$$

Définition (Partie fractionnaire)

$$\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} = x - \lfloor x \rfloor$$

Exemples

$$\{2,4\} = 0,4 \quad \{-2,4\} = 0,6$$

Propriété $\forall x \in \mathbb{R}, \lfloor x \rfloor \leq x < \lfloor x \rfloor + 1$

Corollaire $\forall x \in \mathbb{R}, \{x\} \in [0,1[$

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad (59 - x_2 - y_1) \\ \quad x_1 + \frac{12}{10}x_2 + \frac{1}{10}y_1 = \frac{59}{10} \\ \quad x_1, \quad x_2, \quad y_1 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point initial $(x_1, x_2) = \left(\frac{59}{10}, 0\right) \Rightarrow y_1 = 0$

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad (59 - x_2 - y_1) \\ \quad x_1 + \frac{12}{10}x_2 + \frac{1}{10}y_1 = \frac{59}{10} \\ \quad x_1, \quad x_2, \quad y_1 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point initial $(x_1, x_2) = \left(\frac{59}{10}, 0\right) \Rightarrow y_1 = 0$

► $(x_1, x_2) \in \mathbb{N}^2$ et $y_1 \in \mathbb{N} \Rightarrow x_1 + \left\lfloor \frac{12}{10} \right\rfloor x_2 + \left\lfloor \frac{1}{10} \right\rfloor y_1 \leq \left\lfloor \frac{59}{10} \right\rfloor$

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad (59 - x_2 - y_1) \\ \quad x_1 + \frac{12}{10}x_2 + \frac{1}{10}y_1 = \frac{59}{10} \\ \quad x_1, \quad x_2, \quad y_1 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point initial $(x_1, x_2) = \left(\frac{59}{10}, 0\right) \Rightarrow y_1 = 0$

- $(x_1, x_2) \in \mathbb{N}^2$ et $y_1 \in \mathbb{N} \Rightarrow x_1 + \left\lfloor \frac{12}{10} \right\rfloor x_2 + \left\lfloor \frac{1}{10} \right\rfloor y_1 \leq \left\lfloor \frac{59}{10} \right\rfloor$

$$\Rightarrow -\left\{ \frac{12}{10} \right\} x_2 - \left\{ \frac{1}{10} \right\} y_1 \leq -\left\{ \frac{59}{10} \right\}$$

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad (59 - x_2 - y_1) \\ \quad x_1 + \frac{12}{10}x_2 + \frac{1}{10}y_1 = \frac{59}{10} \\ \quad x_1, \quad x_2, \quad y_1 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point initial $(x_1, x_2) = \left(\frac{59}{10}, 0\right) \Rightarrow y_1 = 0$

- ▶ $(x_1, x_2) \in \mathbb{N}^2$ et $y_1 \in \mathbb{N} \Rightarrow x_1 + \left\lfloor \frac{12}{10} \right\rfloor x_2 + \left\lfloor \frac{1}{10} \right\rfloor y_1 \leq \left\lfloor \frac{59}{10} \right\rfloor$
 $\Rightarrow -\left\{ \frac{12}{10} \right\} x_2 - \left\{ \frac{1}{10} \right\} y_1 \leq -\left\{ \frac{59}{10} \right\}$
- ▶ Nouvelle coupe : $-\frac{2}{10}x_2 - \frac{1}{10}y_1 \leq -\frac{9}{10}$

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad (59 - x_2 - y_1) \\ \quad x_1 + \frac{12}{10}x_2 + \frac{1}{10}y_1 = \frac{59}{10} \\ \quad x_1, \quad x_2, \quad y_1 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point initial $(x_1, x_2) = \left(\frac{59}{10}, 0\right) \Rightarrow y_1 = 0$

- ▶ $(x_1, x_2) \in \mathbb{N}^2$ et $y_1 \in \mathbb{N} \Rightarrow x_1 + \left\lfloor \frac{12}{10} \right\rfloor x_2 + \left\lfloor \frac{1}{10} \right\rfloor y_1 \leq \left\lfloor \frac{59}{10} \right\rfloor$
 $\Rightarrow -\left\{ \frac{12}{10} \right\} x_2 - \left\{ \frac{1}{10} \right\} y_1 \leq -\left\{ \frac{59}{10} \right\}$
- ▶ Nouvelle coupe : $-\frac{2}{10}x_2 - \frac{1}{10}y_1 \leq -\frac{9}{10}$ (i.e. $x_1 + x_2 \leq 5$)

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad (59 - x_2 - y_1) \\ x_1 + \frac{12}{10}x_2 + \frac{1}{10}y_1 = \frac{59}{10} \\ -\frac{2}{10}x_2 - \frac{1}{10}y_1 + \gamma = -\frac{9}{10} \\ x_1, \quad x_2, \quad y_1, \quad \gamma \geq 0 \end{array} \right.$$

Point initial $(x_1, x_2) = \left(\frac{59}{10}, 0\right) \Rightarrow y_1 = 0$

$$\begin{aligned} & \blacktriangleright (x_1, x_2) \in \mathbb{N}^2 \text{ et } y_1 \in \mathbb{N} \Rightarrow x_1 + \left\lfloor \frac{12}{10} \right\rfloor x_2 + \left\lfloor \frac{1}{10} \right\rfloor y_1 \leq \left\lfloor \frac{59}{10} \right\rfloor \\ & \qquad \Rightarrow -\left\{ \frac{12}{10} \right\} x_2 - \left\{ \frac{1}{10} \right\} y_1 \leq -\left\{ \frac{59}{10} \right\} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} & \blacktriangleright \text{Nouvelle coupe : } -\frac{2}{10}x_2 - \frac{1}{10}y_1 \leq -\frac{9}{10} \text{ (i.e. } x_1 + x_2 \leq 5) \\ & \qquad \Rightarrow \text{nouvelle variable d'écart } \gamma \end{aligned}$$

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad (59 - x_2 - y_1) \\ x_1 + \frac{12}{10}x_2 + \frac{1}{10}y_1 = \frac{59}{10} \\ - \frac{2}{10}x_2 - \frac{1}{10}y_1 + \gamma = -\frac{9}{10} \\ x_1, \quad x_2, \quad y_1, \quad \gamma \geq 0 \end{array} \right.$$

Point initial $(x_1, x_2) = \left(\frac{59}{10}, 0\right) \Rightarrow y_1 = 0$

$$\begin{aligned} & \blacktriangleright (x_1, x_2) \in \mathbb{N}^2 \text{ et } y_1 \in \mathbb{N} \Rightarrow x_1 + \left\lfloor \frac{12}{10} \right\rfloor x_2 + \left\lfloor \frac{1}{10} \right\rfloor y_1 \leq \left\lfloor \frac{59}{10} \right\rfloor \\ & \qquad \Rightarrow - \left\{ \frac{12}{10} \right\} x_2 - \left\{ \frac{1}{10} \right\} y_1 \leq - \left\{ \frac{59}{10} \right\} \end{aligned}$$

$$\blacktriangleright \text{Nouvelle coupe : } -\frac{2}{10}x_2 - \frac{1}{10}y_1 \leq -\frac{9}{10} \text{ (i.e. } x_1 + x_2 \leq 5)$$

\Rightarrow nouvelle variable d'écart γ

\blacktriangleright Résolution du nouveau problème

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad \frac{109}{2} - \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma \\ x_1 - \frac{1}{2}y_1 + 6\gamma = \frac{1}{2} \\ x_2 + \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma = \frac{9}{2} \\ x_1, x_2, \quad y_1, \quad \gamma \geq 0 \end{array} \right.$$

Point $(x_1, x_2) = \left(\frac{1}{2}, \frac{9}{2}\right) \Rightarrow y_1 = 0$ et $\gamma = 0$

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad \frac{109}{2} - \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma \\ x_1 - \frac{1}{2}y_1 + 6\gamma = \frac{1}{2} \\ x_2 + \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma = \frac{9}{2} \\ \\ x_1, x_2, \quad y_1, \quad \gamma \geq 0 \end{array} \right.$$

Point $(x_1, x_2) = \left(\frac{1}{2}, \frac{9}{2}\right) \Rightarrow y_1 = 0$ et $\gamma = 0$

- ▶ Nouvelle coupe (selon la première équation) :

$$-\left\{-\frac{1}{2}\right\}y_1 = -\left\{\frac{1}{2}\right\} \iff -\frac{1}{2}y_1 \leq -\frac{1}{2}$$

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad \frac{109}{2} - \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma \\ x_1 - \frac{1}{2}y_1 + 6\gamma = \frac{1}{2} \\ x_2 + \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma = \frac{9}{2} \\ \\ x_1, x_2, \quad y_1, \quad \gamma \geq 0 \end{array} \right.$$

Point $(x_1, x_2) = \left(\frac{1}{2}, \frac{9}{2}\right) \Rightarrow y_1 = 0$ et $\gamma = 0$

- ▶ Nouvelle coupe (selon la première équation) :

$$-\left\{-\frac{1}{2}\right\}y_1 = -\left\{\frac{1}{2}\right\} \iff -\frac{1}{2}y_1 \leq -\frac{1}{2}$$

(i.e. $5x_1 + 6x_2 \leq 29$)

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad \frac{109}{2} - \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma \\ x_1 - \frac{1}{2}y_1 + 6\gamma = \frac{1}{2} \\ x_2 + \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma = \frac{9}{2} \\ -\frac{1}{2}y_1 + \gamma_2 = -\frac{1}{2} \\ x_1, x_2, \quad y_1, \quad \gamma_1, \gamma_2 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point $(x_1, x_2) = \left(\frac{1}{2}, \frac{9}{2}\right) \Rightarrow y_1 = 0$ et $\gamma_1 = 0$

- Nouvelle coupe (selon la première équation) :

$$-\left\{-\frac{1}{2}\right\}y_1 = -\left\{\frac{1}{2}\right\} \iff -\frac{1}{2}y_1 \leq -\frac{1}{2}$$

(i.e. $5x_1 + 6x_2 \leq 29$) \Rightarrow nouvelle variable d'écart γ_2

Application sur le problème du grossiste

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{l} \max \quad \frac{109}{2} - \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma \\ x_1 - \frac{1}{2}y_1 + 6\gamma = \frac{1}{2} \\ x_2 + \frac{1}{2}y_1 - 5\gamma = \frac{9}{2} \\ -\frac{1}{2}y_1 + \gamma_2 = -\frac{1}{2} \\ x_1, x_2, y_1, \gamma, \gamma_2 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point $(x_1, x_2) = \left(\frac{1}{2}, \frac{9}{2}\right) \Rightarrow y_1 = 0$ et $\gamma = 0$

- ▶ Nouvelle coupe (selon la première équation) :

$$-\left\{-\frac{1}{2}\right\}y_1 = -\left\{\frac{1}{2}\right\} \iff -\frac{1}{2}y_1 \leq -\frac{1}{2}$$

(i.e. $5x_1 + 6x_2 \leq 29$) \Rightarrow nouvelle variable d'écart γ_2

- ▶ Résolution du nouveau problème

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{ll} \max & (54 - 5\gamma_1 - \gamma_2) \\ & x_1 + 6\gamma_1 - \gamma_2 = 1 \\ & x_2 - 5\gamma_1 + \gamma_2 = 4 \\ & y_1 - 2\gamma_2 = 1 \\ & x_1, x_2, y_1, \gamma_1, \gamma_2 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point final $(x_1, x_2) = (1, 4) \Rightarrow y_1 = 1$ et $(\gamma_1, \gamma_2) = (0, 0)$

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{ll} \max & (54 - 5\gamma_1 - \gamma_2) \\ & x_1 + 6\gamma_1 - \gamma_2 = 1 \\ & x_2 - 5\gamma_1 + \gamma_2 = 4 \\ & y_1 - 2\gamma_2 = 1 \\ & x_1, x_2, y_1, \gamma_1, \gamma_2 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point final $(x_1, x_2) = (1, 4) \Rightarrow y_1 = 1$ et $(\gamma_1, \gamma_2) = (0, 0)$

Remarque

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{ll} \max & (54 - 5\gamma_1 - \gamma_2) \\ & x_1 + 6\gamma_1 - \gamma_2 = 1 \\ & x_2 - 5\gamma_1 + \gamma_2 = 4 \\ & y_1 - 2\gamma_2 = 1 \\ & x_1, x_2, y_1, \gamma_1, \gamma_2 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point final $(x_1, x_2) = (1, 4) \Rightarrow y_1 = 1$ et $(\gamma_1, \gamma_2) = (0, 0)$

Remarque

- Solution du problème non relaxé : $(1, 4)$

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{ll} \max & (54 - 5\gamma_1 - \gamma_2) \\ & x_1 + 6\gamma_1 - \gamma_2 = 1 \\ & x_2 - 5\gamma_1 + \gamma_2 = 4 \\ & y_1 - 2\gamma_2 = 1 \\ & x_1, x_2, y_1, \gamma_1, \gamma_2 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point final $(x_1, x_2) = (1, 4) \Rightarrow y_1 = 1$ et $(\gamma_1, \gamma_2) = (0, 0)$

Remarque

- ▶ Solution du problème non relaxé : $(1, 4)$
- ▶ Solution du problème relaxé : $(5, 9; 0)$

$$(P^S) \left\{ \begin{array}{ll} \max & (54 - 5\gamma_1 - \gamma_2) \\ & x_1 + 6\gamma_1 - \gamma_2 = 1 \\ & x_2 - 5\gamma_1 + \gamma_2 = 4 \\ & y_1 - 2\gamma_2 = 1 \\ & x_1, x_2, y_1, \gamma_1, \gamma_2 \geq 0 \end{array} \right.$$

Point final $(x_1, x_2) = (1, 4) \Rightarrow y_1 = 1$ et $(\gamma_1, \gamma_2) = (0, 0)$

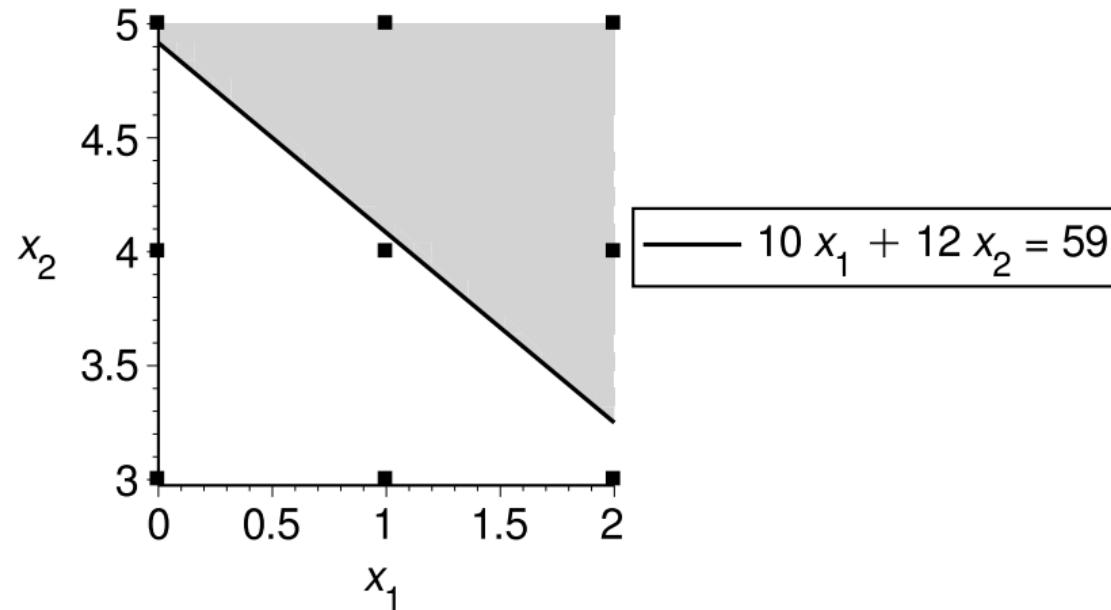
Remarque

- ▶ Solution du problème non relaxé : $(1, 4)$
- ▶ Solution du problème relaxé : $(5, 9; 0)$

Les optima ne sont pas forcément proches l'une de l'autre.

Application sur le problème du grossiste

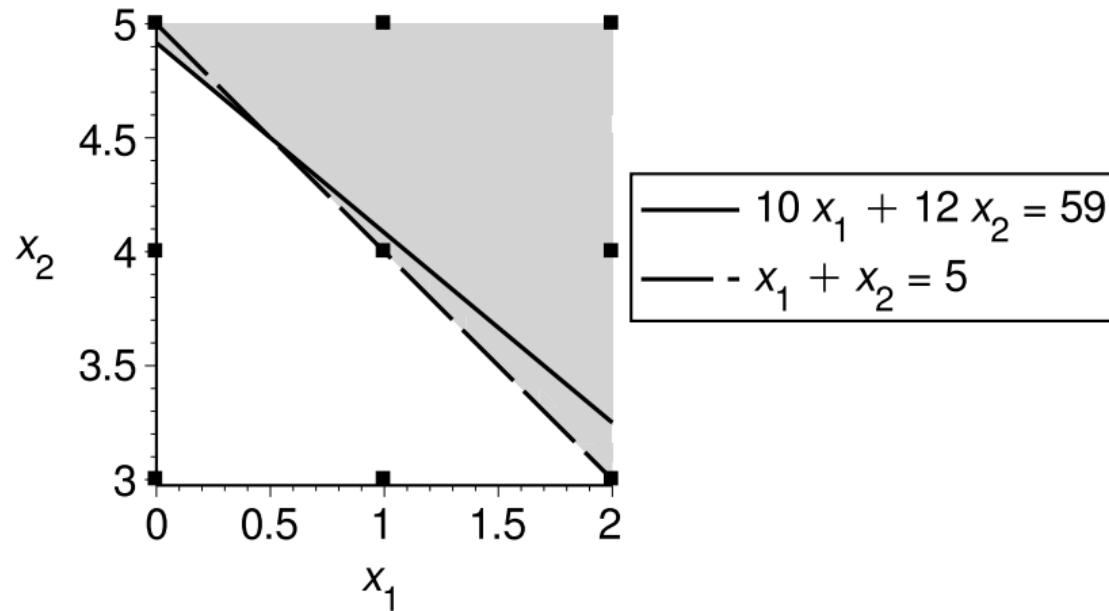
Évolution du domaine des contraintes



$$\text{Optimum : } \left(\frac{59}{10}, 0 \right)$$

Application sur le problème du grossiste

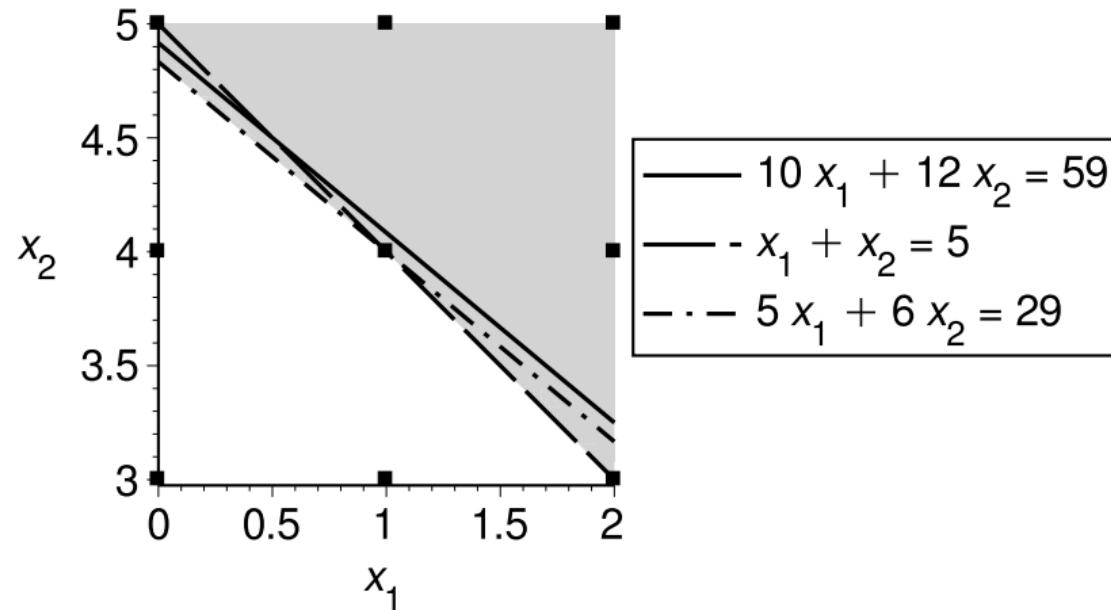
Évolution du domaine des contraintes



$$\text{Optimum: } \left(\frac{1}{2}, \frac{9}{2}\right)$$

Application sur le problème du grossiste

Évolution du domaine des contraintes



Optimum : (1, 4)

Méthode des coupes

Disposition pratique

Initialisation

On part donc du tableau final de la résolution du problème relaxé

$$(P) \begin{cases} \max & (10x_1 + 11x_2) \\ & 10x_1 + 12x_2 \leq 59 \\ & x_1, \quad x_2 \geq 0 \end{cases}$$

	x_1	x_2	y_1	
f	0	-1	-1	-59
x_1	1	12/10	1/10	59/10

Première itération

	x_1	x_2	y_1	
f	0	-1	-1	-59
x_1	1	12/10	1/10	59/10

Première itération

	x_1	x_2	y_1	
f	0	-1	-1	-59
x_1	1	12/10	1/10	$59/10$

1. Choix de la variable de coupe

Variables non entières \Rightarrow coupe possible

Critère de choix usuel : plus grande partie fractionnaire

$\Rightarrow x_1$

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
γ_1	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

1. Choix de la variable de coupe

Variables non entières \Rightarrow coupe possible

Critère de choix usuel : plus grande partie fractionnaire

$\Rightarrow x_1$

2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_1

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
γ_1	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

1. Choix de la variable de coupe

Variables non entières \Rightarrow coupe possible

Critère de choix usuel : plus grande partie fractionnaire

$\Rightarrow x_1$

2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_1 3. Variable sortante : γ_1 (nécessairement)

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
γ_1	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

1. Choix de la variable de coupe

Variables non entières \Rightarrow coupe possible

Critère de choix usuel : plus grande partie fractionnaire

$\Rightarrow x_1$

2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_1 3. Variable sortante : γ_1 (nécessairement)

4. Choix de la variable entrante : méthode « primale-duale »

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
γ_1	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

1. Choix de la variable de coupe

Variables non entières \Rightarrow coupe possible

Critère de choix usuel : plus grande partie fractionnaire

$\Rightarrow x_1$

2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_1 3. Variable sortante : γ_1 (nécessairement)

4. Choix de la variable entrante : méthode « primale-duale »

$$x_2 : \frac{-1}{-2/10} = 5$$

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
γ_1	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

1. Choix de la variable de coupe

Variables non entières \Rightarrow coupe possible

Critère de choix usuel : plus grande partie fractionnaire

$\Rightarrow x_1$

2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_1 3. Variable sortante : γ_1 (nécessairement)

4. Choix de la variable entrante : méthode « primale-duale »

$$x_2 : \frac{-1}{-2/10} = 5$$

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
γ_1	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

1. Choix de la variable de coupe

Variables non entières \Rightarrow coupe possible

Critère de choix usuel : plus grande partie fractionnaire

$\Rightarrow x_1$

2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_1 3. Variable sortante : γ_1 (nécessairement)

4. Choix de la variable entrante : méthode « primale-duale »

$$x_2 : \frac{-1}{-2/10} = 5 \quad , \quad y_1 : \frac{-1}{-1/10} = 10$$

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
γ_1	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

1. Choix de la variable de coupe

Variables non entières \Rightarrow coupe possible

Critère de choix usuel : plus grande partie fractionnaire

$\Rightarrow x_1$

2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_1 3. Variable sortante : γ_1 (nécessairement)

4. Choix de la variable entrante : méthode « primale-duale »

$$x_2 : \frac{-1}{-2/10} = 5 \quad , \quad y_1 : \frac{-1}{-1/10} = 10$$

Rapport le plus faible (afin de rester dans les contraintes) : x_2

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
γ_1	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
x_2	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

5. Placement de la nouvelle variable

Échanger les variables dans la base

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
x_2	0	-2/10	-1/10	1	-9/10

5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ	
f	0	-1	-1	0	-59
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
x_2	0	1	1/2	-5	9/2

5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution
► $L_2 \leftarrow L_2 / (-2/10)$

Première itération

f	x_1	x_2	y_1	γ	
	0	0	-1/2	-5	-109/2
x_1	1	12/10	1/10	0	59/10
x_2	0	1	1/2	-5	9/2

5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution
 - ▶ $L_2 \leftarrow L_2 / (-2/10)$
 - ▶ $L_f \leftarrow L_f - (-1)L_2$

Première itération

	x_1	x_2	y_1	γ	
f	0	0	-1/2	-5	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	9/2

5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution

- ▶ $L_2 \leftarrow L_2 / (-2/10)$
- ▶ $L_f \leftarrow L_f - (-1)L_2$
- ▶ $L_1 \leftarrow L_1 - (12/10)L_2$

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ	
f	0	0	-1/2	-5	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	9/2

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ	
f	0	0	-1/2	-5	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	9/2

1. Choix de la variable de coupe :

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ	
f	0	0	-1/2	-5	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	9/2

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ	γ_2	
f	0	0	-1/2	-5	0	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	0	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	0	9/2
γ_2	0	0	-1/2	0	1	-1/2

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ	γ_2	
f	0	0	-1/2	-5	0	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	0	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	0	9/2
γ_2	0	0	-1/2	0	1	-1/2

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ	γ_2	
f	0	0	-1/2	-5	0	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	0	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	0	9/2
γ_2	0	0	-1/2	0	1	-1/2

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2
4. Choix de la variable entrante :

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ	γ_2	
f	0	0	-1/2	-5	0	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	0	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	0	9/2
γ_2	0	0	-1/2	0	1	-1/2

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2
4. Choix de la variable entrante : y_1

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
f	0	0	-1/2	-5	0	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	0	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	0	9/2
y_1	0	0	-1/2	0	1	-1/2

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2
4. Choix de la variable entrante : y_1
5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
f	0	0	-1/2	-5	0	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	0	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	0	9/2
y_1	0	0	-1/2	0	1	-1/2

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2
4. Choix de la variable entrante : y_1
5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution

Deuxième itération

f	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
	0	0	-1/2	-5	0	-109/2
x_1	1	0	-1/2	6	0	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	0	9/2
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2
4. Choix de la variable entrante : y_1
5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution
► $L_3 \leftarrow L_3 / (-1/2)$

Deuxième itération

f	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
	0	0	0	-5	-1	-54
x_1	1	0	-1/2	6	0	1/2
x_2	0	1	1/2	-5	0	9/2
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2
4. Choix de la variable entrante : y_1
5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution
 - ▶ $L_3 \leftarrow L_3 / (-1/2)$
 - ▶ $L_f \leftarrow L_f - (-1/2)L_3$

Deuxième itération

f	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
0	0	0	0	-5	-1	-54
x_1	1	0	0	6	-1	1
x_2	0	1	1/2	-5	0	9/2
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2
4. Choix de la variable entrante : y_1
5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution
 - ▶ $L_3 \leftarrow L_3 / (-1/2)$
 - ▶ $L_f \leftarrow L_f - (-1/2)L_3$
 - ▶ $L_1 \leftarrow L_1 + (1/2)L_3$

Deuxième itération

f	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
	0	0	0	-5	-1	-54
x_1	1	0	0	6	-1	1
x_2	0	1	0	-5	1	4
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2
4. Choix de la variable entrante : y_1
5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution

- ▶ $L_3 \leftarrow L_3 / (-1/2)$
- ▶ $L_f \leftarrow L_f - (-1/2)L_3$
- ▶ $L_1 \leftarrow L_1 + (1/2)L_3$
- ▶ $L_2 \leftarrow L_2 - (1/2)L_3$

Deuxième itération

	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
f	0	0	0	-5	-1	-54
x_1	1	0	0	6	-1	1
x_2	0	1	0	-5	1	4
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe : x_1 (ou x_2)
2. Ajout de la coupe et de sa variable d'écart γ_2
3. Variable sortante : γ_2
4. Choix de la variable entrante : y_1
5. Placement de la nouvelle variable
Échanger les variables dans la base
6. Pivoter le tableau pour réaliser la substitution

- ▶ $L_3 \leftarrow L_3 / (-1/2)$
- ▶ $L_f \leftarrow L_f - (-1/2)L_3$
- ▶ $L_1 \leftarrow L_1 + (1/2)L_3$
- ▶ $L_2 \leftarrow L_2 - (1/2)L_3$

Terminaison

	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
f	0	0	0	-5	-1	-54
x_1	1	0	0	6	-1	1
x_2	0	1	0	-5	1	4
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe

Toutes les variables sont entières \Rightarrow STOP

Terminaison

	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
f	0	0	0	-5	-1	-54
x_1	1	0	0	6	-1	1
x_2	0	1	0	-5	1	4
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe

Toutes les variables sont entières \Rightarrow STOP

2. Lecture de l'optimum

Terminaison

	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
f	0	0	0	-5	-1	-54
x_1	1	0	0	6	-1	1
x_2	0	1	0	-5	1	4
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe

Toutes les variables sont entières \Rightarrow STOP

2. Lecture de l'optimum

► $(x_1, x_2) = (1, 4) \in \mathbb{N}^2$

Terminaison

	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
f	0	0	0	-5	-1	-54
x_1	1	0	0	6	-1	1
x_2	0	1	0	-5	1	4
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe

Toutes les variables sont entières \Rightarrow STOP

2. Lecture de l'optimum

- ▶ $(x_1, x_2) = (1, 4) \in \mathbb{N}^2$
- ▶ $y_1 = 1$

Terminaison

	x_1	x_2	y_1	γ_1	γ_2	
f	0	0	0	-5	-1	-54
x_1	1	0	0	6	-1	1
x_2	0	1	0	-5	1	4
y_1	0	0	1	0	-2	1

1. Choix de la variable de coupe

Toutes les variables sont entières \Rightarrow STOP

2. Lecture de l'optimum

- ▶ $(x_1, x_2) = (1, 4) \in \mathbb{N}^2$
- ▶ $y_1 = 1$
- ▶ $\gamma_1 = \gamma_2 = 0$

Terminaison

Terminaison assurée si l'on choisit toujours la variable de coupe selon la plus grande partie fractionnaire.

Complexité de la méthode

Complexité exponentielle en nombre de coupes.

⇒ Peu efficace