RICERCA OPERATIVA – 5 crediti

Tema d'esame del 10 dicembre 2010

	COGNOME:	Questo foglio deve
Scrivere subito!	NOME:	essere consegnato
	MATRICOLA:	con l'elaborato

1. Una società di navigazione effettua un servizio di trasporto merci su tre rotte 1, 2 e 3 dove la domanda è rispettivamente di 20000, 5000 e 15000 tonnellate. La società usa per questo servizio tre tipi di nave (A, B e C) e dispone di 100 navi di tipo A, 80 navi di tipo B e 150 navi di tipo C. Ciascuna nave ha capacità e costo di trasporto unitario che dipendono dal tipo e dalla rotta, come riassunto nella seguente tabella:

TIPO NAVE	ROTTA	Capacità massima	Costo €/tonnellata
A	1	150	60
A	2	120	30
A	3	non imp	piegabile
В	1	100	45
В	2	80	25
В	3	90	30
С	1	non imp	iegabile
С	2	60	50
С	3	140	35

Si scriva il modello di programmazione lineare per determinare il piano di trasporto che soddisfa la domanda sulle tre rotte minimizzando i costi complessivi, tenendo conto che:

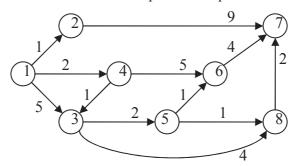
- sulla rotta 1 ci possono essere al massimo 10 navi di tipo A;
- sulla rotta 2 può effettuare servizio un solo tipo di nave;
- se le navi di tipo B sono utilizzate sulla rotta 2, allora queste non possono essere utilizzate né sulla rotta 1, né sulla rotta 3.
- 2. Si risolva il seguente problema di programmazione lineare con il metodo del simplesso, a partire dalla base relativa alle variabili x_1 , x_2 , x_3 e applicando la regola di Bland:

max
$$x_1 + 5x_2$$

s.t. $x_1 \le 5$
 $x_1 + x_2 \ge -1$
 $x_2 + 2x_3 = -2$
 $x_1 \ge 0$ $x_2 \le 0$ $x_3 \ge 0$

... CONTINUA SUL RETRO ...

3. Si vogliono determinare i cammini minimi composti da al più 4 archi sul seguente grafo:



- si scelga un algoritmo appropriato e si motivi la scelta;
- si calcolino i cammini minimi con al più quattro archi dal nodo 1 verso tutti gli altri nodi (<u>i</u> passi dell'algoritmo vanno riportati in una tabella e giustificati);
- si ricavi un cammino minimo di al più quattro archi da 1 a 7, descrivendo il procedimento adottato.
- **4.** Enunciare le condizioni di complementarietà primale-duale e applicarle per dimostrare che $(x_1,x_2,x_3) = (0,4,8)$ è soluzione ottima del seguente problema:

5. Si consideri il seguente tableau del simplesso:

	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	b
- Z	-12	0	0	0	-147	-239
x_3	75	0	1	0	-12	0
x_4	46	0	0	1	1	4/3
x_2	13	1	0	0	0	0

Riportare il tableau sul foglio e rispondere (NON su questo foglio) alle seguenti domande:

- (a) Cerchiare i possibili elementi pivot e dire su quale elemento si farà pivot alla prossima iterazione del simplesso usando la regola di Bland?
- (b) Stabilire, SENZA EFFETTUARE LE OPERAZIONI DI PIVOT, quale sarà il valore della funzione obiettivo alla fine della prossima iterazione del simplesso. GIUSTIFICARE LA RISPOSTA!
- (c) Alla fine della prossima iterazione sarà cambiata la base corrente: sarà cambiato anche il vertice del poliedro associato alla nuova base? GIUSTIFICARE LA RISPOSTA!
- **6.** Discutere la complessità computazionale dell'algoritmo di Dijkstra per il problema del cammino minimo.

2

Esercizio 1

Si noti che i costi sono dati per tonnellata, mentre molti vincoli riguardano il numero di navi. Si introducono pertanto DUE tipi di variabili, uno relativo al numero di tonnellate per tipo di nave e rotta, e uno relativo al numero di navi per tipo e per rotta. Ovviamente, tali variabili sono tra loro legate e tale legame deve risultare nei vincoli.

Variabili decisionali:

- x_{ij} : numero di tonnellate di merce trasportate da navi di tipo $i \in \{A, B, C\}$ sulla rotta $j \in \{1, 2, 3\}$ (le variabili x_{C1} e x_{A3} non sono definite, visto che le navi non sono impiegabili);
- y_{ij} : numero di navi di tipo $i \in \{A, B, C\}$ da utilizzare sulla rotta $j \in \{1, 2, 3\}$ (le variabili y_{C1} e y_{A3} non sono definite);
- z_{ij} : variabile logica che vale 1 se si utilizzano navi di tipo $i \in \{A, B, C\}$ sulla rotta $j \in \{1, 2, 3\}$ (definite per i necessari $i \in j$);

Parametro M: costante sufficientemente grande (grande almeno quanto il massimo numero di navi di un determinato tipo su una determinata rotta, ad esempio M = 150).

Modello:

```
\min 60x_{A1} + 30x_{A2} + 45x_{B1} + 25x_{B2} + 30x_{B3} + 50x_{C2} + 35x_{C3}
subject to
 x_{A1} + x_{B1} \geq 20000 //(richiesta tonnellate su rotta 1)
 x_{A2} + x_{B2} + x_{C2} \ge 5000 //(richiesta tonnellate su rotta 2)
                      \geq 15000 //(richiesta tonnellate su rotta 3)
 x_{B3} + x_{C3}
 //(legame tra le variabili x_{ij} e y_{ij}:
 // si devono avere almeno y_{ij} navi per trasportare x_{ij} tonnellate)
 x_{A1} \le 150y_{A1} x_{A2} \le 120y_{A2}
 x_{B1} \le 100y_{B1} x_{B2} \le 80y_{B2} x_{B3} \le 90y_{B3}
                   x_{C2} \le 60y_{C2} x_{C3} \le 140y_{C3}
 //(massimo numero di navi)
 y_{A1} + y_{A2}
                      \leq 100 //(di tipo A)
 y_{B1} + y_{B2} + y_{B3} \le 80 //(di tipo B)
 y_{C2} + y_{C3} \leq 150 //(\text{di tipo C})
                      \leq 10 //(tipo A su rotta 1)
 y_{A1}
```

Esercizio 2

Passo alla forma standard:

1. Funzione obiettivo di minimo:

$$\min -x_1 + 5x_2$$

2. vincoli di uguaglianza:

3. variabili non negative: effettuo la sostituzione $\hat{x}_2 = -x_2, \, \hat{x}_2 \geq 0$

 x_1 \hat{x}_2 x_3 4. termini noti non negativi

Imposto il tableau del simplesso:

	\downarrow					
	x_1	\hat{x}_2	x_3	x_4	x_5	$ar{b}$
-z	-1	5	0	0	0	0
?	1	0	0	1	0	5
?	-1	1	0	0	1	1
?	0	1	-2	0	0	2

Faccio entrare in base la variabile x_1 trasformando, con operazioni elementari, la colonna di x_1 nella prima colonna della matrice identità sormontata da 0.

		\downarrow					
	x_1	\hat{x}_2	x_3	x_4	x_5	$ar{b}$	
-z	0	5	0	1	0	5	$R_0' \leftarrow R_0 + R_1'$
x_1	1	0	0	1	0	5	$R_1' \leftarrow R_1$
?	0	1	0	1	1	6	$R_2' \leftarrow R_2 + R_1'$
?	0	1	-2	0	0	2	$R_3' \leftarrow R_3$

Faccio entrare in base la variabile \hat{x}_2 (corrispondente a x_2) trasformando, con operazioni elementari, la colonna di \hat{x}_2 nella seconda colonna della matrice identità sormontata da 0.

			\downarrow				
	x_1	\hat{x}_2	x_3	x_4	x_5	$ar{b}$	
-z	0	0	0	-4	-5	-25	$R_0' \leftarrow R_0 - 5R_2'$
x_1	1	0	0	1	0	5	$R_1' \leftarrow R_1$
\hat{x}_2	0	1	0	1	1	6	$R_2' \leftarrow R_2$
?	0	0	-2	-1	-1	-4	$R_3' \leftarrow R_3 - R_2'$

Faccio entrare in base la variabile x_3 trasformando, con operazioni elementari, la colonna di x_3 nella terza colonna della matrice identità sormontata da 0.

				\downarrow			
	x_1	\hat{x}_2	x_3	x_4	x_5	$ar{b}$	
-z	0	0	0	-4	-5	-25	$R_0' \leftarrow R_0$
x_1	1	0	0	1	0	5	$R_1' \leftarrow R_1$
\hat{x}_2	0	1	0	1	1	6	$R_2' \leftarrow R_2$
$\leftarrow x_3$	0	0	1	1/2	1/2	2	$R_3' \leftarrow -1/2R_3$

Il tableau è ora in **forma canonica** rispetto alla base x_1, \hat{x}_2, x_3 , come richiesto. Inoltre la base proposta è **ammissibile**, essendo tutte le variabili della forma standard ≥ 0 e, quindi, possiamo partire con il simplesso.

Iterazione 1

Ci sono due variabili candidate a entrare in base $(x_4 e x_5)$ e, applicando la regola di Bland, entra in base x_4 .

Esce dalla base
$$\arg \min \left\{ \frac{5}{1}, \frac{6}{1}, \frac{2}{1/2} \right\} = \arg\{4\} = x_3$$

Eseguo quindi l'operazione di pivot sull'elemento cerchiato (riquatrato per motivi tipografici, ndr) nella tabella precedente, ottenendo:

					\downarrow		
	x_1	\hat{x}_2	x_3	x_4	x_5	$ar{b}$	
-z	0	0	8	0	-1	-9	$R_0' \leftarrow R_0 + 4R_3'$
x_1	1	0	-1	0	-1	1	$R_1' \leftarrow R_1 - R_3'$
\hat{x}_2	0	1	-2	0	0	2	$R_2' \leftarrow R_2 - R_3'$
$\leftarrow x_4$	0	0	2	1	1	4	$R_3' \leftarrow 2R_3$

Iterazione 2

C'è una sola variabile candidata a entrare in base: entra in base x_5 .

Esce dalla base $\arg\min\left\{X,X,\frac{4}{1}\right\} = \arg\{4\} = x_4$

Eseguo quindi l'operazione di pivot sull'elemento cerchiato (riquatrato per motivi tipografici, ndr) nella tabella precedente, ottenendo:

	x_1	\hat{x}_2	x_3	x_4	x_5	$ar{b}$	
-z	0	0	10	1	0	-5	$R_0' \leftarrow R_0 + R_3'$
x_1	1	0	1	1	0	5	$R_1' \leftarrow R_1 + R_3'$
\hat{x}_2	0	1	-2	0	0	2	$R_2' \leftarrow R_2$
x_5	0	0	2	1	1	4	$R_3' \leftarrow R_3$

Non essendoci costi ridotti negativi, abbiamo raggiunto la condizione di arresto del simplesso per ottimalità della base trovata. Abbiamo quindi la soluzione ottima, per il problema in forma standard:

$$x_1 = 5, \hat{x}_2 = 2, x_5 = 4, x_3 = x_4 = 0$$
 $z_{MIN} = -(-5) = 5$

Per il problema originario, la soluzione è:

$$x_1 = 5, x_2 = -2, x_3 = 0$$
 $z = -5$

con il primo vincolo soddisfatto all'uguaglianza ($x_4 = 0$) e il secondo vincolo lasco ($x_5 > 0$). Per verifica, i valori della funzione obiettivo e il modo di soddisfazione dei vincoli possono essere controllati sostituendo i valori delle variabili nella formulazione originaria.

Esercizio 3

 $Scelta\ dell'algoritmo$: anche se tutti i costi sono positivi, posso applicare solo l'algoritmo di Bellman-Ford che è l'unico che dia la possibilità di calcolare i cammini minimi con il massimo numero di archi. Infatti, è possibile dimostrare che, all'iterazione k dell'algoritmo, le etichette corrispondono ai cammini minimi che utilizzano al più k archi. Applicheremo quindi Bellman-Ford fermandoci alla quarta iterazione, dopo l'inizializzazione.

Applicazione dell'algoritmo: si utilizza una tabella che riporta una riga per ogni iterazione dell'algoritmo. Ogni colonna della tabella è dedicata ad un nodo e riporta, iterazione dopo iterazione, l'evoluzione delle rispettive etichette. L'ultima colonna riporta i nodi aggiornati nel corso dell'iterazione: all'iterazione successiva è sufficiente controllare solo gli archi uscenti da questi nodi.

iter.	n. 1	nodo 2	nodo 3	nodo 4	nodo 5	nodo 6	nodo 7	nodo 8	Aggior.
init.	0(^)	$+\infty_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	1
h=1	$0_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}/1_{(1)}$	$+\infty_{(\wedge)}/5_{(1)}$	$+\infty_{(\wedge)}/2_{(1)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	$+\infty_{(\wedge)}$	2, 3, 4
h=2	$0_{(\wedge)}$	1(1)	$5_{(1)}/3_{(4)}$	$2_{(1)}$	$+\infty_{(\wedge)}/7_{(3)}$	$+\infty_{(\wedge)}/7_{(4)}$	$+\infty_{(\land)}/10_{(2)}$	$+\infty_{(\land)}/9_{(3)}$	7, 5, 8, 3, 6
h = 3	$0_{(\wedge)}$	1(1)	3(4)	$2_{(1)}$	$7_{(3)}/5_{(3)}$	$7_{(4)}$	$10_{(2)}$	$9_{(3)}/8_{(5)}/7_{(3)}$	8,5
h=4	0(^)	1(1)	3(4)	2(1)	5(3)	$7_{(4)}/6_{(5)}$	$10_{(2)}/9_{(8)}$	$7_{(3)}/6_{(5)}$	7, 6, 8

Le etichette di una riga sono ottenute controllando i vincoli duali su tutti gli archi uscenti dai nodi "aggiornati" della riga (iterazione) precedente secondo la regola

if $\pi_j > \pi'_i + c_{ij}$ then $\pi_j = \pi'_i + c_{ij}$ and p(j) = i dove (i, j) è uno degli archi uscenti da un nodo i aggiornato all'iterazione precedente, π_j è l'etichetta corrente (sulla riga corrente) del nodo j, π'_i è l'etichetta del nodo i all'iterazione (riga) precedente e c_{ij} è il costo dell'arco (i, j). Nella tabella indico in rosso (anziché sbarrate perché non riesco a farlo in LATEX, ndr) le etichette che sono migliorate durante la stessa iterazione 1 .

Si fa notare che, grazie al fatto di utilizzare l'etichetta del nodo i all'iterazione precedente negli aggiornamenti, all'iterazione h garantiamo di considerare lunghezze di cammini con al più h archi. Ad esempio, per ottenere le etichette all'iterazione con h=4, partendo dal nodo 8, la cui etichetta valeva 7 all'iterazione precedente, si aggiorna il nodo 7 al valore 9 (10 > 7 + 2 = 9) e non al valore 6 + 2 = 8 (il valore 6 è relativo all'iterazione corrente e non a quella precedente e, infatti, l'etichetta 8 per il nodo 7 è ottenibile con 5 archi e non con 4).

Un cammino minimo con al massimo 4 archi da 1 a 7: seguo la catena dei predecessori a partire dal nodo 7 sulla riga con h=4 e, ad ogni passo, considero la riga precedente (con h diminuito di 1). Ottengo $7 \leftarrow 8 \leftarrow 3 \leftarrow 4 \leftarrow 1$, cioè il cammino di 4 archi $1 \rightarrow 4 \rightarrow 3 \rightarrow 8 \rightarrow 7$ il cui costo è effettivamente 9.

Esercizio 4

Il testo potrebbe contenere un errore: la funzione obiettivo è $\max x_1 + x_2$

Prima di tutto, come richiesto, enunciare le condizioni complementarietà primale-duale, ad esempio fissando una forma per il problema primale [vedi enunciato del Teorema 5 delle dispense sulla dualità e le condizioni estese ai singoli vincoli, come alla fine di pagina 18 e/o all'inizio di pagina 19 delle stesse dispense].

Procediamo con la verifica dell'ottimalità della soluzione data per il problema di programmazione lineare proposto.

1. Verifica dell'ammissibilità primale della soluzione data:

$$2x_1 + 3x_2 - x_3 = 0 + 12 - 8 = 4$$
 (OK)
 $x_1 + x_2 = 0 + 4 \le 4$ (OK)
 $0 \le 0, 4 \ge 0, 8 \ge 0$ (domini OK)

2. Passaggio al duale:

¹Le etichette sbarrate [in rosso, ndr] dipendono dall'ordine in cui si controllano gli archi che escono dai nodi aggiornati. Le etichette finali [in nero, ndr] invece devono essere le stesse, indipendentemente dall'ordine di controllo.

- 3. Applicazione delle condizioni:
 - Il primo vincolo primale è di uguaglianza: non ci sono condizioni di complementarietà con la relativa variabile duale u_1

•
$$u_2(x_1 + x_2 - 4) = 0 \rightarrow u_2(0) = 0 \rightarrow //$$

•
$$(2u_1 + u_2 - 1)x_1 = 0 \rightarrow (2u_1 + u_2 - 1)0 = 0 \rightarrow //$$

•
$$(3u_1 + u_2 - 1)x_2 = 0 \rightarrow (3u_1 + u_2 - 1)4 = 0 \rightarrow 3u_1 + u_2 - 1 = 0$$
 (prima condizione)

•
$$(-u_1 - 0)x_3 = 0 \to (-u_1)8 = 0 \to u_1 = 0$$
 (seconda condizione)

Mettiamo a sistema le due condizioni trovate:

$$\begin{cases} 3u_1 + u_2 - 1 = 0 \\ u_1 = 0 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} u_2 = 1 \\ u_1 = 0 \end{cases}$$

La soluzione duale trovata:

- soddisfa i tre vincoli duali $(2u_1 + u_2 = 1 \le 1, 3u_1 + u_2 = 1 \ge 1, -u_1 = 0 \ge 0)$;
- soddisfa i vincoli di dominio $(u_1 \text{ libera}, u_2 = 1 \ge 0)$
- è in scarti complementari con la soluzione primale data (per costruzione).

Pertanto, le due soluzioni sono ottime per i rispettivi problemi primale e duale.

[Per verifica, i valori delle funzioni obiettivo sono uguali: $x_1 + x_2 = 4u_1 + 4u_2 = 4$, il ché verifica il Corollario 2 della dualità (all'ottimo, i valori delle funzioni obiettivo primale e duale coincidono).]

Esercizio 5

(a)		x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	$ar{b}$
	-z	-12	0	0	0	-147	-239
	x_3	75	0	1	0	-12	0
	x_4	46	0	0	1	1	4/3
	$\leftarrow x_2$	13	1	0	0	0	0

La regola di Bland impone il pivot sull'elemento "13" (entra in base x_1 che ha indice minore di x_5 e esce dalla base x_2 che ha indice minore di x_3).

- (b) Il valore della funzione obiettivo rimane invariato in quanto si tratta di un'iterazione degenere del simplesso, visto che il minimo rapporto $\theta = 0$. Di conseguenza, il miglioramento atteso per la funzione obiettivo è $-12\theta = 0$.
- (c) Anche se cambia la base corrente, non cambia il vertice del poliedro associato alla nuova base. Infatti, i nuovi valori delle variabili in base sono $x_2 = \theta = 0$, $x_3 = 0 75\theta = 0$ e $x_4 = 4/3 46\theta = 4/3$. Si passa quindi dalla soluzione base degenere $x_3 = 0, x_4 = 4/3, x_2 = 0$ ($x_1 = x_5 = 0$ fuori base) alla soluzione di base sempre degenere $x_3 = 0, x_4 = 4/3, x_1 = 0$ ($x_2 = x_5 = 0$ fuori base), che rappresenta lo stesso vertice del poliedro ammissibile.

Esercizio 6

Si consiglia di riportare i passi dell'algoritmo di Dijkstra e, quindi, discuterne la complessità come fatto nelle dimostrazione della Proprietà 10 a pagina 31 delle dispense sugli algoritmi per problemi di cammino minimo. Quindi si può approfondire con qualche dettaglio sull'influenza della scelta di opportune strutture dati per migliorare l'efficienza, come dal paragrafo 6.2 delle stesse dispense.