Modelli di Programmazione Lineare

Immagine che contiene tavolo

Descrizione generata automaticamente

Casi:

* Esattamente 🡪 e vincoli
* Almeno 🡪
* Al massimo (generico) 🡪 vincolo di
* Sconto 🡪 variabile binaria associata e poi moltiplico il val. iniziale
* Costo fisso 🡪 variabile binaria apposita, da aggiungere poi in f.o.

Andare con calma; individuare le variabili decisionali, scrivere la f.o. e aiutarsi con almeno uno dei vincoli ulteriori, in quanto almeno uno/due servono a capire come scrivere le variabili decisionali.

Attivare sempre le variabili logiche (vuol dire semplicemente metterle in relazione con le variabili decisionali di riferimento, quindi quelle con gli stessi indici)

Nei domini:

* si mette insieme reale () quando si ha la possibilità di avere frazioni/radici, etc. in base alle quantità del problema)
* normalmente, quasi sempre, si mettere nell’insieme degli interi ()

Simplesso

* Funzione obiettivo (se in forma di massimo 🡪 diventa di minimo e cambio i segni; se in forma di minimo si lascia uguale)
* Vincoli di uguaglianza 🡪 Aggiungo le variabili di slack e la disuguaglianza diventa uguaglianza
  + Se si ha la variabile di slack viene aggiunta come positiva
  + Se si ha la variabile di slack viene aggiunta come negativa
* Variabili non negative (vincolo ) 🡪 Aggiungo variabile positiva e cambio il segno a tutte le occorrenze della stessa variabile
* Termini noti non negativi 🡪 Se un termine noto è negativo, cambio segno a tutta la disuguaglianza

Imposto i tableau, ricordando che: ogni volta mi chiedo:

* È in forma canonica? Basta avere le colonne (anche sparse/non in ordine) della matrice identità nel tableau
* È ammissibile? 🡪 Tutti i devono essere positivi (se parto da una base ammissibile, rimango sempre in base ammissibile; mai dire che è impossibile)
* È ottima? 🡪 Devo avere tutti i costi ridotti
* È illimitata? 🡪 Mi trovo ad avere un costo ridotto con tutti i valori negativi sotto
* Entra in base? 🡪 La variabile costo ridotto negativo di indice minimo (Bland); non si va per ordine
* Esce dalla base 🡪 La variabile che ha rapporto minimo prendendo in colonna la variabile entrante e facendo i rapporti minimi
* Ricordarsi che si sostituisce una variabile entrante/uscente esattamente nella posizione da cui è stata tolta (quindi, se da tolgo per far entrare es. , l’ordine rimane )

Ad ogni passaggio, eseguo il pivoting ogni volta prendendo in colonna la variabile che esce e in riga la variabile che entra. Quando trovo la soluzione, considero che è tutta la colonna in cui prendo il valore della funzione obiettivo (solitamente e cambio segno per questo motivo); normalmente, il suo valore migliora tra i passaggi) e come vincoli abbiamo:

* I vincoli laschi, nel momento in cui abbiamo una variabile in base
* I vincoli saturi, nel momento in cui abbiamo una variabile fuori base (quindi, pari a 0)

Nella scrittura della soluzione, si deve considerare che nel tableau abbiamo , dunque va invertito il segno. Poi, si scrivono tutte le variabili (es. ho 7 variabili e scriverò con rispettivo valore (positivo se in base, quindi guardo quello che sta in , 0 altrimenti se fuori base.

Domande ulteriori:

* Individuazione basi ottime senza operazioni di pivot
  + Basta vedere dove sono gli 1 della matrice identità e dove ci sono costi ridotti non negativi [quindi, sia uguali a 0 che maggiori]
* Stabilire, SENZA EFFETTUARE LE OPERAZIONI DI PIVOT, quale sarà il valore della funzione obiettivo alla fine della prossima iterazione del simplesso. GIUSTIFICARE LA RISPOSTA!
  + Usiamo la regola di Bland per selezionare la variabile entrante ed eseguiamo il solito rapporto minimo tra e il punto della variabile entrante
    - Se si ha un rapporto minimo pari a 0, la f.o. non migliora
    - Se si ha un rapporto minimo in cui il minimo elemento è positivo, basta sommare al valore della f.o. il valore dell’elemento con rapporto minimo. In particolare, si esegue il prodotto tra il coefficiente individuato dall’operazione di rapporto minimo e il costo ridotto della stessa colonna. Successivamente, si esegue una somma algebrica con il valore della funzione obiettivo (solitamente, si ha
* Alla fine della prossima iterazione sarà cambiata la base corrente: sarà cambiato anche il vertice del poliedro associato alla nuova base? GIUSTIFICARE LA RISPOSTA!
  + Se si ha un’iterazione degenere, il vertice del poliedro non cambia
  + Se invece si ha un’iterazione non degenere, il vertice del poliedro cambia
  + In generale si ragiona che si effettua una sottrazione tra e , per tutte le variabili in base. In base alla regola di Bland e rispetto a chi esce dalla base e letteralmente rifacciamo lo stesso calcolo rispetto alla variabile che entra in base, tenendo le altre. Capiamo così se l vertice è cambiato o meno.
* Riusciamo ad individuare una soluzione di base corrispondente? Quale?
  + Il tableau è in forma canonica e individuo come soluzione di base una tra quelle in cui si hanno i coefficienti della matrice identità
  + Perché non è ottima?
    - Perché avremo coefficienti di costo ridotto negativo
  + È ottima?
    - Basterà avere tutti coefficienti di costo ridotto positivo
* Perché la teoria del simplesso non consente l’operazione di pivot sull’elemento X?
  + L’operazione non è consentita, in quanto quell’elemento non corrisponde al rapporto minimo
* Su quali elementi è possibile effettuare il pivot secondo le regole del simplesso (indipendentemente dalle regole anticiclo)?
  + Prendendo come elementi la variabile che entra e la variabile che esce. Se ci sono più valori di questo tipo, questo si deve al rapporto minimo e vanno individuati tutti (ad eccezione di quelli che non rispettano le regole di pivot)
* Considerando le variabili ordinate per indice crescente, quale sarà il cambio base secondo le regole del simplesso e applicando Bland?
  + Si considerano le regole dette (variabile che entra/variabile che esce secondo quanto scritto sopra) e poi prendo le variabili con indice posizionale minore (secondo Bland)
* Supponiamo di effettuare un cambio base in cui entra in base la variabile X: perché la soluzione di base ottenuta a seguito di questo cambio base è sicuramente degenere?
  + In questo caso, avremmo X righe corrispondenti al rapporto minimo, pertanto avremo che almeno una esce dalla base con valore 0, mentre le altre Y assumeranno valore 0 rimanendo in base.

Immagine che contiene testo

Descrizione generata automaticamente

Condizioni primale/duale e passaggio al problema duale

Immagine che contiene tavolo

Descrizione generata automaticamenteRiferite ai domini A vinc. prim. dom. duale & A vinc. duale. dom. prim. (se massimo va letta da duale a primale)

Dualità

Abbiamo il problema e la verifica di una certa soluzione. Quindi:

1. Verifica ammissibilità primale dela soluzione data 🡪 Sostituisco i valori della soluzione che mi viene data dentro i vincoli e verifico se sono rispettate tutte le disuguaglianze
2. Passaggio al problema duale
   1. Se ho problema di min passo a problema di max (o viceversa)
   2. Considero come termini tutti i termini noti (compresi i loro coefficienti)
   3. Per ogni vincolo, prendo tutti le variabili con coefficienti alla colonna corrispondente alla posizione , e:
      1. Quando passo da a riporto l’opposto del segno delle disuguaglianze rispetto al corrispondente vincolo primale
      2. Quando passo da a , riporto lo stesso segno delle disuguaglianze di dominio del corrispondente problema primale
      3. se non c’è nulla per la variabile quando si scrive il vincolo duale, si vede come (questo anche per quando si deve trovare l’opposto tra min-max o max-min; l’opposto di una uguaglianza è sempre una uguaglianza)
   4. Si inseriscono i domini delle variabili, considerando che:
      1. Se passo da problema di a problema di , il dominio delle duali corrisponde allo stesso segno di uguaglianze/disuguaglianze delle variabili primali
      2. Se passo da problema di a problema di , il dominio delle duali corrisponde all’opposto del segno di uguaglianze/disuguaglianze delle variabili primali
3. CCPD
   1. Primo pezzo: vincoli primali
      1. Prendo posizione della riga attuale e lo moltiplico per il vincolo primale in posizione portando a sinistra il termine noto (cambiando quindi di segno)

Es.

* + 1. Sostituisco quindi i valori della soluzione iniziale data nel vincolo e:
       1. Se ho un valore , allora questo viene considerato come condizione
       2. Se ho un valore , allora non mi dice nulla e non lo considero
    2. Se ho vincoli di uguaglianza non posso dire nulla (*deriva dall’ammissibilità primale*)
  1. Secondo pezzo: vincoli duali
     1. Prendo posizione della riga attuale e lo moltiplico per il vincolo duale in posizione portando a sinistra il termine noto (cambiando quindi di segno)

Es.

* + 1. Sostituisco il valore di in quella posizione e faccio le verifiche dei sottocasi (1) e (2) del primale
    2. Se ho vincoli di uguaglianza, devo verificare che non faccia già parte dei vincoli; nel qual caso lo considero (*deriva dall’ammissibilità duale*), altrimenti no

1. Sistema di equazioni CCPD
   1. Metto insieme tutte le condizioni che ho trovato fino ad ora e vado a sostituire i valori di oppure di che ho già dal sistema di equazioni e risolvo trovando tutte le soluzioni
2. Verifica ammissibilità duale
   1. Verifico se tutti i valori di soddisfano i vincoli duali (cioè, soddisfano le disuguaglianze)
   2. Verifico se tutti i valori di soddisfano il relativo dominio duale (es. soddisfa )
3. Conclusioni:
   1. (Happy Ending)
      1. è ammissibile primale (come da verifica), è ammissibile duale (come da verifica e costruzione,

sono in scarti complementari Le soluzioni sono ottime (il problema dice verifica che sono ottime)

* + 1. Per verifica si confrontino i valori delle f.o. primale e duale; saranno uguali per il corollario della dualità forte
  1. (Bad Ending)
     1. Se non soddisfa i vincoli di dominio, la/le soluzione/i è/sono stata/e trovata/e, ma non è/sono ammissibile/i; pertanto, non è possibile trovare nessuna soluzione ammissibile (il problema dice verifica se sono ottime)

Enunciare le condizioni di complementarietà primale-duale

Immagine che contiene testo

Descrizione generata automaticamente

Immagine che contiene testo

Descrizione generata automaticamente

Le condizioni di complementarità primale-duale possono essere enunciate testualmente come segue:

* Il valore ottimale del problema primale è uguale al valore ottimale del problema duale.
* Esiste una coppia primale-duale fattibile ( tale che , e
* Per qualsiasi soluzione primale fattibile e qualsiasi soluzione duale fattibile , deve essere il caso che , con l'uguaglianza che vale se e solo se e formano una coppia primale-duale fattibile.

Branch and Bound

1) Individuare se si tratta di problema di minimo o di massimo

* Se si tratta di problema di minimo se i LB aumentano (o non decrescono) di padre in figlio
  + In questo caso avremo come struttura [LB; S.A]
* Se si tratta di problema di massimo se gli UB decrescono (o non crescono) di padre in figlio
  + In questo caso avremo come struttura [S.A.; UB]

2) Individuare nodi da poter chiudere

In generale, non chiudo i nodi che sono già sviluppati (quindi normalmente, il nodo radice e nodi che hanno dei figli)

* Se si tratta di problema di minimo
  + Cerco l’UB minimo tra i nodi aperti (soluzione corrente/incumbent), successivamente considero come LB quelli al LB minimo, perché promettono potenzialmente una soluzione migliore
  + Chiudo i nodi con UB >= S.A.
* Se si tratta di problema di massimo
  + Cerco il LB massimo tra i nodi aperti (soluzione corrente/incumbent), successivamente considero come UB quelli all’UB massimo, perché promettono potenzialmente una soluzione migliore
  + Chiudo i nodi con LB <= S.A.

3) Intervallo ottimo / Intervallo in cui è sicuramente compreso il valore della f.o. / Miglior valore per una soluzione ammissibile

* Se si tratta di problema di minimo
  + Considero l’intervallo della soluzione ottima, quindi il miglior LB (quello minore) tra i nodi aperti e l’incumbent (migliore soluzione) corrente, quindi l’UB minimo
* Se si tratta di problema di massimo
  + Considero l’intervallo della soluzione ottima, quindi l’incumbent (migliore soluzione) corrente, cioè il miglior UB (quello maggiore) tra i nodi aperti e il LB massimo
* Attenzione: occorre considerare la ricerca dell’intervallo ottimo su *tutti i nodi non chiusi*; questo comprende anche cercare nei nodi (cosa che non si fa nei contesti degli altri punti).

4) Quale sarà il nodo sviluppato per primo in una strategia Best Bound First?

* Se si tratta di problema di minimo
  + Si sceglie il nodo con il miglior LB (quello minimo) tra i nodi aperti
* Se si tratta di problema di massimo
  + Si sceglie il nodo con il miglior UB (quello massimo) tra i nodi aperti

5) Si supponga che lo sviluppo di cui al punto precedenti porti a due nodi figli, di cui uno è relativo ad un insieme di soluzioni vuoto. Si dia un esempio di valori di LB e UB relativi al secondo nodo, che consentano di riconoscere subito la soluzione ottima del problema.

* Come in classe, consideriamo l’esempio di un nodo che porta a e , di cui quest’ultimo è una soluzione ammissibile. Si considerano i nodi rimasti aperti, quindi e i nodi individuati come aperti dall’esercizio.
* Si considera che si fa riferimento all’intervallo ottimo individuato in un punto precedente normalmente (sapendo che influisce il mantenimento regole di minimo e di massimo e sapendo che il nodo è figlio di )
  + Se per un problema di minimo basterà avere un LB a quello ottimo e un valore che sia minore dell’UB, possibilmente quello ottimo
  + Se per un problema di massimo basterà avere un UB a quello ottimo e un valore che sia minore del LB, possibilmente quello ottimo
* Normalmente, si può avere lo stesso valore per UB e LB per semplicità (non per forza)

6) Individuare possibili valori per UB per mantenere la coerenza con problema di massimo (vuol dire che si avrà “UB?” sul testo)

* Se si tratta di problema di massimo se gli UB decrescono (o non crescono) di padre in figlio; quindi, basterà individuare un UB minore rispetto al nodo radice e un UB dello stesso nodo più grande rispetto a quello dei figli

7) Individuare possibili valori per LB per mantenere la coerenza con problema di minimo (vuol dire che si avrà “LB?” sul testo)

* Se si tratta di problema di massimo se i LB crescono (o non decrescono) di padre in figlio; quindi, basterà individuare un LB maggiore rispetto al nodo radice e un LB dello stesso nodo più piccolo rispetto a quello dei figli

AMPL

*From my understanding*, non appaiono sempre all’esame, ma può succedere. Descrivo i passi utili, almeno per me, per risolverli:

* Creare il file .mod traducendo letteralmente i dati del problema per come si presentano; si inseriscono gli insiemi *(set*), i parametri *param* e le variabili (*var*) logiche (*binary*) oppure intere (*integer*), *seguendo l’ordine degli indici*.
  + Attenzione che i *param* hanno le graffe e gli indici *maiuscoli*
  + Scrivere la funzione obiettivo (*maximize/minimize*), inserendo tutti gli indici necessari alla serie;
  + Descrivere tutti i vincoli (si dia un nome generico), considerando come indice più esterno quello della condizione di esistenza (quindi, se avrò a fianco al vincolo allora una serie sarà descritta come

*s {j in J}: sum{i in I} (etc)*

* Creare il file .dat considerando di valorizzare insiemi e parametri esattamente come dati dal problema; quindi, si inserisce sempre per ogni variabile del problema che sia *in linea* (scrivibile su una sola riga)
  + Se si ha a che fare con dati in forma matriciale, prima vanno i due punti, si inserisce in riga il primo indice (normalmente ), poi vanno messi i e si inserisce in colonna il secondo indice (normalmente )
  + Mettere il alla fine di ogni variabile/comando/variabile matriciale
* Scrivere il file *.run* minimale (*reset, model (file), data (file), option solver (cplex/gurobi, etc.), display (vars)*