Investigación Operativa

Hoja 5

Problema 1

a)

$$\max x_1 + x_2$$
s. a.: $-2x_1 + x_2 \le 1$

$$x_2 \le 2$$

$$x_1 + x_2 \le 3$$

$$x_1 \ge 0, x_2 \ge 0$$

	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	
<i>x</i> ₃	-2	1	1	0	0	1
<i>x</i> ₄	0	1	0	1	0	2
x ₅	1	1	0	0	1	3
	1	1	0	0	0	Z-0

	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	
<i>x</i> ₃	0	3	1	0	2	7
<i>X</i> ₄	0	1	0	1	0	2
x_1	1	1	0	0	1	3
	0	0	0	0	-1	Z-3

	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	
<i>x</i> ₃	0	0	1	-3	2	1
x_2	0	1	0	1	0	2
x_1	1	0	0	-1	1	1
	0	0	0	0	-1	Z-3

Las dos últimas tablas presentan soluciones básicas factibles óptimas.

La solución óptima del **problema dual** del problema resuelto mediante el algoritmo del Simplex es:

$$y_1^* = 0, \ y_2^* = 0, \ y_3^* = 1$$

$$\max \quad 3x_1 + 2x_2$$
s. a.: $2x_1 - 3x_2 \le 6$

$$-4x_1 + 5x_2 \le 15$$

$$x_1 \ge 0, x_2 \ge 0$$

	x_1	x_2	<i>x</i> ₃	<i>X</i> ₄	
<i>x</i> ₃	2	-3	1	0	6
<i>X</i> ₄	-4	5	0	1	15
	3	2	0	0	Z-0

	<i>X</i> ₁	<i>X</i> ₂	X 3	X 4	
x_1	1	-3/2	1/2	0	3
<i>X</i> ₄	0	-1	2	1	27
	0	13/2	-3/2	0	Z-9

Problema con solución no acotada.

El problema dual es infactible.

$$\max \quad -2x_1^+ + 2x_1^- + x_2$$

$$s. \ a.: \quad -x_1^+ + x_1^- + 2x_2 \le 4$$

$$-7x_1^+ + 7x_1^- + 2x_2 \le 15$$

$$x_1^+ - x_1^- + x_2^- \le 3$$

$$x_1^+ \ge 0, \ , x_1^- \ge 0, \ x_2 \ge 0$$

	x_1^+	x_1^-	x_2	x_3	x_4	<i>x</i> ₅	
<i>x</i> ₃	-1	1	2	1	0	0	4
X 4	-7	7	2	0	1	0	15
X 5	1	-1	1	0	0	1	3
	-2	2	1	0	0	0	Z-0

	x_1^+	x_1^-	x_2	x_3	x_4	x_5	
<i>x</i> ₃	0	0	12/7	1	-1/7	0	13/7
x_1^-	-1	1	2/7	0	1/7	0	15/7
X 5	0	0	9/7	0	1/7	1	36/7
	0	0	3/7	0	-2/7	0	Z-(30/7)

	x_1^+	x_1^-	x_2	X 3	X 4	X 5	
x_2	0	0	1	7/12	-1/12	0	13/12
x_1^-	-1	1	0	-1/6	1/6	0	11/6
X 5	0	0	0	-3/4	1/4	1	15/4
	0	0	0	-1/4	-1/4	0	Z-(19/4)

Solución óptima: $x_1^* = -11/6$, $x_2^* = 13/12$, $x_3^* = 0$, $x_4^* = 0$, $x_5^* = 15/4$, $z^* = 19/4$.

La solución óptima del **problema dual** del problema resuelto mediante el algoritmo del Simplex es:

$$y_1^* = \frac{1}{4}, \quad y_2^* = \frac{1}{4}, \quad y_3^* = 0$$

$$\min \quad 3x_1 + x_2$$

$$s. a.: \quad -x_1 + 2x_2 \le 4$$

$$7x_1 + 2x_2 \ge 15$$

$$x_1 \ge 0, x_2 \ge 0$$

Fase I $(w = x_5)$

	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	
X 3	-1	2	1	0	0	4
X 5	7	2	0	-1	1	15
	3	1	0	0	0	Z-0
	-7	-2	0	1	0	W - 15

	\boldsymbol{x}_1	x_2	<i>X</i> ₃	X 4	X 5	
<i>x</i> ₃	0	16/7	1	-1/7	1/7	43/7
x_1	1	2/7	0	-1/7	1/7	15/7
	0	1/7	0	3/7	-3/7	Z-(45/7)
	0	0	0	0	1	W-0

Fase II
$$(z = 3x_1 + x_2)$$

Solución óptima:
$$x_1^* = 15/7$$
, $x_2^* = 0$, $x_3^* = 43/7$, $x_4^* = 0$, $z^* = 45/7$

La solución óptima del **problema dual** del problema resuelto mediante el algoritmo del Simplex es:

$$y_1^* = 0$$
, $y_2^* = \frac{3}{7}$

Investigación Operativa

Hoja 5 (2)

max
$$z = 3x_1 + x_2 + 5x_3$$

s. a.: $6x_1 + 3x_2 + 5x_3 \le 45$ (mano de obra)
 $3x_1 + 4x_2 + 5x_3 \le 30$ (materiales)
 $x_1, x_2, x_3 \ge 0$

a) Determinar los niveles óptimos de producción y el beneficio máximo.

	x_1	x_2	<i>X</i> ₃	x_4	X ₅	
<i>X</i> ₄	6	3	5	1	0	45
X 5	3	4	5	0	1	30
	3	1	5	0	0	Z-0

	x_1	x_2	<i>x</i> ₃	<i>X</i> ₄	X 5	
<i>X</i> ₄	3	-1	0	1	-1	15
x_3	3/5	4/5	1	0	1/5	6
	0	-3	0	0	-1	z-30

I) Solución óptima: $\bar{x}_1 = 0$, $\bar{x}_2 = 0$, $\bar{x}_3 = 6$, $\bar{x}_4 = 15$, $\bar{x}_5 = 0$, $z^* = 30$

Observación: Existe solución óptima básica alternativa,

	x_1	x_2	<i>X</i> ₃	<i>X</i> ₄	X ₅	
x_1	1	-1/3	0	1/3	-1/3	5
<i>x</i> ₃	0	1	1	-1/5	2/5	3
	0	-3	0	0	-1	Z-30

II) Solución óptima (básica) alternativa: $\overline{x}_1 = 5$, $\overline{x}_2 = 0$, $\overline{x}_3 = 3$, $\overline{x}_4 = 0$, $\overline{x}_5 = 0$, $z^* = 30$.

b) ¿Cuál sería la solución óptima si el beneficio asociado a la unidad de producto A fuese de 2 unidades monetarias, en lugar de 3?.

max
$$z = 2x_1 + x_2 + 5x_3$$

s. a.: $6x_1 + 3x_2 + 5x_3 \le 45$ (mano de obra)
 $3x_1 + 4x_2 + 5x_3 \le 30$ (materiales)
 $x_1, x_2, x_3 \ge 0$

Puesto que, en la tabla que presenta la solución básica óptima I), x_1 no es variable básica, el único valor que se modifica en dicha tabla es \bar{c}_1 ($\vec{c}_1 = \bar{c}_1 - 1 = -1$). Por tanto, la solución I) es la única solución óptima.

c) Supóngase que pueden obtenerse 15 unidades adicionales de material con un coste global de 10 unidades monetarias. ¿Conviene invertir en la adquisición de material?.

max
$$z = 3x_1 + x_2 + 5x_3$$

s. a.: $6x_1 + 3x_2 + 5x_3 \le 45$ (mano de obra)
 $3x_1 + 4x_2 + 5x_3 \le 45$ (materiales)
 $x_1, x_2, x_3 \ge 0$

Considerando la tabla que presenta la solución óptima I) del problema original. Puesto que

$$B^{-1}(b + \Delta b) = \begin{pmatrix} 15 \\ 6 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ 0 & 1/5 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0 \\ 15 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 15 \\ 6 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} -15 \\ 3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 9 \end{pmatrix}$$

La modificación considerada transforma la tabla I) en la siguiente tabla I').

	x_1	x_2	X 3	X 4	X 5	
<i>X</i> ₄	3	-1	0	1	-1	0
X 3	3/5	4/5	1	0	1/5	9
	0	-3	0	0	-1	z-45

Por tanto, interesa realizar la inversión en material, considerando la solución óptima:

$$\widetilde{x}_1 = 0$$
, $\widetilde{x}_2 = 0$, $\widetilde{x}_3 = 9$, $\widetilde{x}_4 = 0$, $\widetilde{x}_5 = 0$, $\widetilde{z}^* = 45$.

d) Un grupo de ingenieros presenta a la compañía una serie de innovaciones técnicas con las que los requerimientos de material del producto B se reducen a 2 unidades. ¿Afecta esta modificación a la solución óptima alcanzada en a)?.

Puesto que la variable x_2 no es variable básica en ninguna de las soluciones básicas óptimas (I y II) obtenidas en a), en ambas tablas la solución óptima del problema dual es: $\lambda' = (0, 1)$. Por tanto, en ambas tablas $\overline{c}'_2 = -1$. Luego las dos soluciones óptimas básicas obtenidas en a) siguen siendo óptimas.

Se propone:

$$\bar{x}_1 = 0$$
 , $\bar{x}_2 = 2$, $\bar{x}_3 = 0$, $\bar{x}_4 = 7$, $\bar{x}_5 = 0$.

como solución óptima del siguiente problema (P):

$$\max \quad z = 8 x_1 - 9x_2 + 12x_3 + 4x_4 + 11x_5$$
s. a.:
$$2x_1 - 3x_2 + 4x_3 + x_4 + 3x_5 \le 1$$

$$x_1 + 7x_2 + 3x_3 - 2x_4 + x_5 \le 1$$

$$5x_1 + 4x_2 - 6x_3 + 2x_4 + 3x_5 \le 22$$

$$x_1 \ge 0, \quad x_2 \ge 0, \quad x_3 \ge 0, \quad x_4 \ge 0, \quad x_5 \ge 0.$$

Se debe determinar si, la solución propuesta, es efectivamente solución óptima del problema formulado.

Por el corolario del Teorema de Holgura Complementaria, \bar{x} es solución óptima de P, si y sólo si, existe una solución factible \bar{y} , del problema dual de P (el problema D), que satisface las condiciones de holgura complementaria respecto de \bar{x} .

El problema *D* es el problema:

$$\begin{aligned} & \min \quad \mathbf{w} = y_1 + \ y_2 + 22y_3 \\ & \text{s. a.} : \quad 2y_1 + \ y_2 + \ 5y_3 \ge 8 \\ & -3y_1 + \ 7y_2 + \ 4y_3 \ge -9 \\ & 4y_1 + \ 3y_2 - \ 6y_3 \ge 12 \\ & y_1 - \ 2y_2 + \ 2y_3 \ge 4 \\ & 3y_1 + \ y_2 + \ 3y_3 \ge 11 \\ & y_1 \ge 0, \ y_2 \ge 0, \ y_3 \ge 0, \ y_4 \ge 0, \ y_5 \ge 0 \ . \end{aligned}$$

Imponer a $(\bar{y}_1, \bar{y}_2, \bar{y}_3)$ la verificación de las condiciones de holgura complementaria respecto de \bar{x} , significa:

i) Puesto que \bar{x} verifica la segunda restricción del problema P de forma estricta

$$\bar{x}_1 + 7\bar{x}_2 + 3\bar{x}_3 - 2\bar{x}_4 + \bar{x}_5 = 0 < 1$$

debe ser $\bar{y}_2 = 0$.

ii) Puesto que, $\bar{x}_2 = 2 > 0$ y $\bar{x}_4 = 7 > 0$, $(\bar{y}_1, \bar{y}_2, \bar{y}_3)$ debe verificar las restricciones segunda y cuarta del problema D con igualdad.

Es decir, $(\bar{y}_1, \bar{y}_2, \bar{y}_3)$ cumple las condiciones de holgura complementaria respecto de \bar{x} , si y sólo si, se verifica:

$$\begin{cases} \bar{y}_2 = 0 \\ -3\bar{y}_1 + 7\bar{y}_2 + 4\bar{y}_3 = -9 \\ \bar{y}_1 - 2\bar{y}_2 + 2\bar{y}_3 = 4 \end{cases}$$

La solución del sistema de ecuaciones anterior es:

$$\bar{y}_1 = \frac{17}{5}$$
, $\bar{y}_2 = 0$, $\bar{y}_3 = \frac{3}{10}$.

Se verifica: $\bar{y}_1 \ge 0$, $\bar{y}_2 \ge 0$, $\bar{y}_3 \ge 0$.

A continuación, se comprueba si $(\bar{y}_1, \bar{y}_2, \bar{y}_3)$ verifica las restricciones primera, tercera y quinta del problema D.

$$2\bar{y}_1 + \bar{y}_2 + 5\bar{y}_3 = \frac{83}{10} \ge 8$$

$$4\bar{y}_1 + 3\bar{y}_2 - 6\bar{y}_3 = \frac{118}{10} < 12$$

$$3\bar{y}_1 + \bar{y}_2 + 3\bar{y}_3 = \frac{111}{10} \ge 11$$

Al no verificarse la tercera restricción, \bar{y} no es solución factible del problema D. No existe, solución factible dual, que verifique las condiciones de holgura complementaria respecto de \bar{x} . Por tanto, se concluye que \bar{x} no es solución óptima del problema P.

La solución óptima del problema P es:

$$\bar{x}_1 = 0$$
, $\bar{x}_2 = \frac{131}{62}$, $\bar{x}_3 = \frac{5}{62}$, $\bar{x}_4 = \frac{435}{62}$, $\bar{x}_5 = 0$.

La solución óptima del problema *D* es:

$$\bar{y}_1 = \frac{213}{62}$$
, $\bar{y}_2 = \frac{1}{62}$, $\bar{y}_3 = \frac{37}{124}$.

Siendo el valor óptimo de las funciones objetivo de los problemas *P* y *D*:

$$z^* = w^* = \frac{621}{62}.$$

Investigación Operativa

Hoja 5

Problema 4

min
$$z = x_1 - 3x_2 - x_3$$

s.a.: $x_1 + 4x_2 + 3x_3 = 12$
 $x_1 + 2x_2 - x_3 = 4$
 $x_1 \ge 0, x_2 \ge 0, x_3 \ge 0$

FASE I

$$min \quad w = x_4 + x_5$$

$$s.a.: \quad x_1 + 4x_2 + 3x_3 + x_4 = 12$$

$$x_1 + 2x_2 - x_3 + x_5 = 4$$

$$x_1 \ge 0, \quad x_2 \ge 0, \quad x_3 \ge 0, \quad x_4 \ge 0, \quad x_5 \ge 0$$

	x_1	x_2	<i>x</i> ₃	<i>X</i> ₄	X 5	
<i>X</i> ₄	1	4	3	1	0	12
<i>x</i> ₅	1	2	-1	0	1	4
	1	-3	-1	0	0	Z-0
	-2	-6	-2	0	0	W-16

	x_1	x_2	X ₃	x_4	X ₅	
x_4	-1	0	5	1	-2	4
x_2	1/2	1	-1/2	0	1/2	2
	5/2	0	-5/2	0	3/2	Z-(-6)
	1	0	-5	0	3	W-4

	<i>X</i> ₁	x_2	<i>X</i> ₃	X 4	X 5	
<i>x</i> ₃	-1/5	0	1	1/5	-2/5	4/5
x_2	2/5	1	0	1/10	3/10	12/5
	2	0	0	1/2	1/2	Z-(-8)
	0	0	0	1	1	W-0

<u>FASE II</u>

	x_1	x_2	<i>x</i> ₃	X 4	X 5	
<i>x</i> ₃	-1/5	0	1	1/5	-2/5	4/5
x_2	2/5	1	0	1/10	3/10	12/5
	2	0	0	1/2	1/2	Z-(-8)

Solución óptima:

$$x_1^* = 0, \quad x_2^* = \frac{12}{5}, \quad x_3^* = \frac{4}{5}$$

$$z^* = -8$$

a) Se considera la función objetivo: $min z = -x_1 + x_2 + 2x_3$

Por tanto, se calculan los nuevos costes reducidos, a partir de la tabla asociada a la solución óptima, y el nuevo valor de la función objetivo en dicha solución:

$$\bar{c}'_1 = -1 - (2,1) {\binom{-1/5}{2/5}} = -1 < 0$$

$$\left(\bar{c'}_4 = 0 - (2,1) \binom{1/5}{1/10} = -\frac{1}{2}, \quad \bar{c'}_5 = 0 - (2,1) \binom{-2/5}{3/10} = \frac{1}{2}\right)$$

Puesto que el coste reducido de x_1 es negativo, se efectúa el correspondiente pivotaje.

	x_1	x_2	X 3	X 4	X 5	
x_3	-1/5	0	1	1/5	-2/5	4/5
x_2	2/5	1	0	1/10	3/10	12/5
	-1	0	0	-1/2	1/2	Z – 4

	x_1	x_2	<i>x</i> ₃	X 4	X 5	
<i>X</i> ₃	0	1/2	1	1/4	-1/4	2
<i>x</i> ₁	1	5/2	0	1/4	3/4	6
	0	5/2	0	-1/4	5/4	Z - (-2)

$$x_1^* = 6$$
, $x_2^* = 0$, $x_3^* = 2$

$$z^* = -2$$

b) Se considera la función objetivo:
$$min z = \frac{1}{5}x_1 + x_2 + x_3$$

Por tanto, se calculan los nuevos costes reducidos, a partir de la tabla asociada a la solución óptima, y el nuevo valor de la función objetivo en dicha solución:

$$\bar{c}'_1 = \frac{1}{5} - (1,1) {\binom{-1/5}{2/5}} = 0$$

$$\left(\bar{c'}_4 = 0 - (1,1) \binom{1/5}{1/10} = -\frac{3}{10}, \quad \bar{c'}_5 = 0 - (1,1) \binom{-2/5}{3/10} = \frac{1}{10}\right)$$

Puesto que el coste reducido de x_1 es nulo, se efectúa el correspondiente pivotaje, para obtener una solución básica óptima alternativa.

	x_1	x_2	x_3	x_4	<i>x</i> ₅	
<i>x</i> ₃	-1/5	0	1	1/5	-2/5	4/5
<i>x</i> ₂	2/5	1	0	1/10	3/10	12/5
	0	0	0	-3/10	1/10	Z - 16/5

	x_1	x_2	x_3	<i>x</i> ₄	X 5	
<i>X</i> ₃	0	1/2	1	1/4	-1/4	2
<i>x</i> ₁	1	5/2	0	1/4	3/4	6
	0	0	0	-3/10	1/10	Z - 16/5

Solución básica óptima alternativa:

$$x_1^* = 6$$
, $x_2^* = 0$, $x_3^* = 2$

$$z^* = \frac{16}{5}$$

d) Se considera el nuevo vector de términos independientes: $b' = {13 \choose 8}$

Por tanto, se calculan los nuevos valores de los elementos de la columna de la derecha en la tabla asociada a la solución óptima:

$$B^{-1}b' = \begin{pmatrix} 1/5 & -2/5 \\ 1/10 & 3/10 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 13 \\ 8 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -3/5 \\ 37/10 \end{pmatrix}$$

$$c_B^t B^{-1} b' = (-1, -3) {\binom{-3}{5} \choose 37/10} = -\frac{21}{2}$$

	x_1	x_2	<i>x</i> ₃	X 4	X 5	
x_3	-1/5	0	1	1/5	-2/5	-3/5
x_2	2/5	1	0	1/10	3/10	37/10
	2	0	0	1/2	1/2	Z - (-21/2)

Se aplica el algoritmo dual del simplex.

	x_1	x_2	<i>x</i> ₃	<i>X</i> ₄	X 5	
x_1	1	0	-5	-1	2	3
x_2	0	1	2	1/2	-1/2	5/2
	0	0	10	5/2	-7/2	Z - (-9/2)

$$x_1^* = 3$$
, $x_2^* = \frac{5}{2}$, $x_3^* = 0$

$$z^* = -\frac{9}{2}$$

f) Se considera una nueva variable x_4 en el problema original, por lo que las variables artificiales pasan a ser las variables x_5 y x_6 . Hay que calcular la columna, asociada a la nueva variable, que debe introducirse en la tabla asociada a la solución óptima.

$$B^{-1}a_4 = \begin{pmatrix} 1/5 & -2/5 \\ 1/10 & 3/10 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1\\1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -1/5\\2/5 \end{pmatrix}$$

$$\bar{c}_4 = -2 - (-1, -3) {\binom{-1/5}{2/5}} = -1 < 0$$

Puesto que el coste reducido de la nueva variable es negativo, se aplica el algoritmo primal del simplex.

	<i>x</i> ₁	x_2	X 3	X 4	X 5	X 6	
x_3	-1/5	0	1	-1/5	1/5	-2/5	4/5
x_2	2/5	1	0	2/5	1/10	3/10	12/5
	2	0	0	-1	1/2	1/2	Z - (-8)

	X ₁	x_2	<i>X</i> ₃	X 4	X 5	X 6	
x_3	0	1/2	1	0	1/4	-1/4	2
<i>X</i> ₄	1	5/2	0	1	1/4	3/4	6
	3	5/2	0	0	3/4	5/4	Z - (-14)

$$x_1^* = 0$$
, $x_2^* = 0$ $x_3^* = 2$, $x_4^* = 6$

$$z^* = -14$$

min
$$z = x_1 - 3x_2 - x_3$$

s.a.: $x_1 + 4x_2 + 3x_3 = 12$
 $x_1 + 2x_2 - x_3 = 4$
 $-3x_1 - 5x_2 + 3x_3 \le -10$
 $x_1 \ge 0, x_2 \ge 0, x_3 \ge 0$

Se denota por x_6 a la variable de holgura de la última restricción, que se considera nueva variable básica.

	x_1	x_2	<i>X</i> ₃	x_4	X ₅	x_6	
<i>X</i> ₃	-1/5	0	1	1/5	-2/5	0	4/5
x_2	2/5	1	0	1/10	3/10	0	12/5
X 6	-2/5	0	0	-1/10	27/10	1	-2/5
	2	0	0	1/2	1/2	0	Z-(-8)

Se aplica el algoritmo dual del simplex.

	x_1	x_2	<i>X</i> ₃	<i>X</i> ₄	X 5	X 6	
<i>x</i> ₃	0	0	1	1/4	-7/4	-1/2	1
<i>x</i> ₂	0	1	0	0	3	1	2
<i>X</i> ₁	1	0	0	1/4	-27/4	-5/2	1
	0	0	0	0	14	5	Z-(-6)

$$x_1^* = 1$$
, $x_2^* = 1$ $x_3^* = 1$, $x_6^* = 0$

$$z^* = -6$$

$$h$$
)

min
$$z = x_1 - 3x_2 - x_3$$

s.a.: $x_1 + 4x_2 + 3x_3 = 12$
 $x_1 + 2x_2 - x_3 = 4$
 $-x_1 - x_2 - x_3 \le -4$
 $x_1 \ge 0, x_2 \ge 0, x_3 \ge 0$

Se denota por x_6 a la variable de holgura de la última restricción, que se considera nueva variable básica.

	\boldsymbol{x}_1	x_2	X 3	X 4	X 5	X 6	
<i>x</i> ₃	-1/5	0	1	1/5	-2/5	0	4/5
x_2	2/5	1	0	1/10	3/10	0	12/5
X 6	-4/5	0	0	3/10	-1/10	1	-4/5
	2	0	0	1/2	1/2	0	Z-(-8)

Se aplica el algoritmo dual del simplex.

	x_1	x_2	X 3	<i>X</i> ₄	X 5	X 6	
<i>x</i> ₃	0	0	1	1/8	-3/8	-1/4	1
x_2	0	1	0	1/4	1/4	1/2	2
x_1	1	0	0	-3/8	1/8	-5/4	1
	0	0	0	5/4	1/4	5/2	Z-(-6)

$$x_1^* + x_2^* + x_3^* = 4$$

$$x_1^* = 1$$
, $x_2^* = 2$ $x_3^* = 1$, $x_6^* = 0$

$$z^* = -6$$