**DEPARTAMENTO DE INGENIERÍA INDUSTRIAL**

**Entrenamiento 2** ‐ IIND2103 ‐ Principios de Optimización 2024-10

**PROFESORES**: Andrés Medaglia, Camilo Gómez, Daniel Yamín, Juan Diego Aristizábal.

**ASISTENTES**: Laura Levy, Juliana Sánchez, Andrés Rueda.

**DOBLE MONITOR:** Luis Cortés.

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Nombre Completo** | **Código** | **Login** | **Sección Magistral** | **Sección Complementaria** | **Envía por**  **Bloque**  **Neón** |
| Abraham Jesús Bohórquez Gómez | 202222026 | a.bohorquezg | 5 | 4 | **X** |
| Juan José Murillo Aristizábal | 202116898 | j.murilloa | 9 | 5 |  |

Problema 1 - Simplex y Dualidad

Max

s.a.

Teniendo en cuenta el problema inicial, para tenerlo en formato canónico todos los signos de las restricciones deben ser de menor o igual, excluyendo la naturaleza de las variables.

Max

s.a.

Para obtener el problema en formato estándar, se suman holguras en todas las restricciones para obtener la igualdad. Estas nuevas variables de holgura tienen un valor de cero en la función objetivo y su naturaleza es mayor o igual a cero.

De forma genera, así se ve el problema de forma matricial. Las matrices y vectores se expresan a continuación:

1. Para encontrar una solución básica factible se utilizó el método de las dos fases. Para ello, se crea una variable artificial con índice 11. El archivo correspondiente al proceso de este inciso y el que le sigue es el archivo Excel llamado “Excel-Punto1.xsl”

MIN

s.a.

Solo se necesita una variable de decisión artificial ya que solo en una restricción no tenemos factibilidad cuando multiplicamos la base inversa de las variables duales con el vector b.

**Iteración 0:**

6,7,8,11,10}

Revisión de optimalidad

Dirección de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Entra** | X3 |

Longitud de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Sale** | X6 |

Actualización

**Iteración 1:**

3,7,8,11,10}

Revisión de optimalidad

Dirección de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Entra** | X5 |

Longitud de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Sale** | X11 |

Actualización

**Iteración 2:**

3,7,8,5,10}

Revisión de optimalidad

Acá se encuentra una base factible ya que se está minimizando y el valor de los multiplicadores Simplex son mayores o iguales a cero, y la variable artificial no se encuentra en la base, es decir que el problema no es infactible.

1. Partiendo de la base proporcionada, se realizaron iteraciones hasta llegar al óptimo

**Iteración 1:**

Revisión de optimalidad

En esta iteración no se puede declarar optimalidad porque los costos reducidos indican que hay promesa de mejora al entrar algunas variables a la base. Arbitrariamente se escoge que X2 entra a la base.

Dirección de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Entra** | X2 |

Longitud de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Sale** | X8 |

Actualización

**Iteración 2:**

Revisión de optimalidad

En esta iteración no se puede declarar optimalidad porque los costos reducidos indican que hay promesa de mejora al entrar algunas variables a la base. Arbitrariamente se escoge que X4 entra a la base.

Dirección de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Entra** | X4 |

Longitud de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Sale** | X10 |

Actualización

**Iteración 3:**

Revisión de optimalidad

En esta iteración no se puede declarar optimalidad porque los costos reducidos indican que hay promesa de mejora al entrar alguna variable a la base. Se escoge que X3 entre a la base.

Dirección de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Entra** | X3 |

Longitud de movimiento

|  |  |
| --- | --- |
| **Sale** | X6 |

Actualización

**Iteración 4:**

Revisión de optimalidad

En esta iteración si se puede declarar optimalidad porque los costos reducidos indican que no hay promesa de mejora al entrar algunas variables a la base. Hasta acá llega el algoritmo Simplex.

El valor de la función objetivo en el óptimo es de , los índices básicos son:

Los índices no básicos son:

1. Teniendo en cuenta que nuestro problema primal es de maximización, el dual asociado es de minimización y se modela a continuación:

s.a.

Agregando las holguras correspondientes al dual asociado se tiene el siguiente modelo:

s.a.

La implementación de este ejercicio se encuentra en el archivo Python “Punto1-Dual.py”.

Después de ejecutar el modelo con ayuda de la librería Pulp se obtuvieron los siguientes resultados.

Este valor de la función objetivo tiene sentido ya que por teorema de dualidad fuerte la función objetivo en el óptimo del primal es igual a la del dual asociado.

Max

s.a.

s.a.

Teniendo en cuenta el problema primal con la base que nos dan se aplica holgura complementaria para obtener el valor de las variables que se desconocen.

Max

s.a.

s.a.

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | **Solución básica del problema primal** | | | | | | |  |  |
| ¿Factible? | 𝑥1 | 𝑥2 | 𝑥3 | 𝑥4 | 𝑥5 | 𝑠1 | 𝑠2 | 𝑠3 | 𝑠4 | 𝑠5 | 𝑍𝑃 |
| SI | 0 | 0 | 0 | 0 | -120 | 105 | 765 | 220 | 0 | 345 | -1200 |
|  |  |  | **Solución básica del problema dual** | | | | | | |  |  |
| ¿Factible? | 𝑤1 | 𝑤2 | 𝑤3 | 𝑤4 | 𝑤5 | 𝑟1 | 𝑟2 | 𝑟3 | 𝑟4 | 𝑟5 | 𝑍𝐷 |
| NO | 0 | 0 | 0 | 10 | 0 | -27 | -30 | -16 | -5 | 0 | -1200 |

Tabla 1. Resultados inciso g

Por condiciones KKT, no es la base óptima ya que no hay factibilidad dual del problema, las variables no cumplen con la naturaleza de las variables. Por el teorema fundamental de la dualidad, la función objetivo será igual, aunque el primal sea factible y el dual no.

1. Teniendo en cuenta la solución del modelo con Pulp hallada en el inciso f), se tiene la base:

Max

s.a.

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | **Solución básica del problema primal** | | | | | | |  |  |
| ¿Factible? | 𝑥1 | 𝑥2 | 𝑥3 | 𝑥4 | 𝑥5 | 𝑠1 | 𝑠2 | 𝑠3 | 𝑠4 | 𝑠5 | 𝑍𝑃 |
| SI | 0 | 220 | 7 | 39.66 | 106 | 0 | 171 | 0 | 0 | 0 | 5710.33 |
|  |  |  | **Solución básica del problema dual** | | | | | | |  |  |
| ¿Factible? | 𝑤1 | 𝑤2 | 𝑤3 | 𝑤4 | 𝑤5 | 𝑟1 | 𝑟2 | 𝑟3 | 𝑟4 | 𝑟5 | 𝑍𝐷 |
| SI | 1.29 | 0 | 30 | 11.67 | 1.67 | 10.36 | 0 | 0 | 0 | 0 | 5710.33 |

Tabla 2. Resultados inciso h.

Teniendo en cuenta La tabla 2 , se demuestra que esta es la base óptima del problema dual ya que se cumplen las condiciones KKT. El valor de la función objetivo en el óptimo del dual es igual a la del del primal, por teorema de dualidad fuerte, ambos son óptimos.

**Problema 2 – Dualidad**

1. Problema primal explícito

Variables de decision:

En estas variables de decisión explícitas, se busca saber cuántos litros de helado se van a comprar a cada sucursal.

Función Objetivo:

Esta función objetivo minimiza todos los costos de compra de sabores de helado en todas las sucursales.

Restricciones:

Restricciones de suplir con la demanda de cada sabor de helado:

Restricciones de no exceder la capacidad de producción de cada sucursal:

Naturaleza de las variables:

Para solucionar este problema se hace uso de la librería Pulp y el archivo se llama “Punto2-Primal.py”

Los resultados obtenidos son de:

-------------------------------------------------------------------

El valor de la función objetivo es de:

-------------------------------------------------------------------

1. Problema dual explícito

Variables de decisión:

Estas variables de decisión están asociadas a cada restricción de nuestro problema primal.

Función Objetivo:

Esta función objetivo va en sentido contrario al problema primal.

Restricciones:

Restricciones asociadas a la cantidad en litros de helado de cada sabor que se puede comprar a cada sucursal.

Naturaleza de las variables

La naturaleza de las variables está dada por el signo de las restricciones en el problema primal.

Para solucionar este problema se hace uso de la librería Pulp y el archivo se llama “Punto2-Dual.py”

Los resultados obtenidos son de:

-------------------------------------------------------------------

El valor de la función objetivo es de:

-------------------------------------------------------------------

**BONO**:

Para solucionar ambos modelos en Python se usa la librería Python y los archivos se llaman “Punto2-Primal\_Indexado” y “Punto2-Dual\_Indexado”

**CONJUNTOS:**

**PARÁMETROS:**

***Problema Primal Indexado***

**VARIABLES DE DECISIÓN:**

**FUNCIÓN OBJETIVO:**

Esta función objetivo minimiza todos los costos de compra de sabores de helado en todas las sucursales.

**RESTRICCIONES:**

Restricciones de suplir con la demanda de cada sabor de helado:

Restricciones de no exceder la capacidad de producción de cada sucursal:

Naturaleza de las variables:

Respecto al número de variables de decisión, se puede decir que habrán 12 de ellas, esto se debe a que la cardinalidad del conjunto |S| es de 4 elementos, de igual modo se entiende que la cardinalidad del conjunto |H| es de 3 elementos. Al tener las variables que miden los litros de helados comprados en diferentes sucursales, se puede decir que tenemos 12 diferentes combinaciones de variables de decisión en este caso.

Por otro lado, hablando de las restricciones de demanda, se puede decir que únicamente hay 3 restricciones, esto se debe a que el para todo que se encuentra en la restricción indexada es el que nos indica la cantidad de restricciones que se necesitarán para condicionar respecto a cada uno de los tipos de helado. También podemos concluir respecto a las restricciones de capacidad, donde el para todo indica que para cada uno de los elementos del conjunto S se debe tener una restricción, es decir, para la cardinalidad del conjunto |S|, que es 4, se esperan tener 4 restricciones distintas respecto a dicho conjunto de sucursales. No podemos olvidar la naturaleza de las variables, donde al igual que la variable de decisión se tendrán 12 restricciones ya que se combinan la cardinalidad de ambos conjuntos y dan la naturaleza de las variables respecto a ambos conjuntos de elementos.

***Problema Dual Indexado***

**VARIABLES DE DECISIÓN:**

**FUNCIÓN OBJETIVO:**

**RESTRICCIONES:**

Naturaleza de las variables:

Hablando del número de variables de decisión en el problema dual, se puede observar que las variables w, que representan las restricciones de demanda del problema primal, son parte del conjunto H, donde se puede ver que la cardinalidad de dicho conjunto es de 3, por tanto, tenemos 3 variables de decisión relacionadas con dichas restricciones. De igual manera se puede analizar las variables π, que están asociadas con las restricciones de capacidad del problema primal y que pertenecen al conjunto de sucursales, donde su cardinalidad es de 4, y como solo están asociadas a este conjunto se puede decir que solo hay 4 variables relacionadas con estas restricciones. En total, se puede concluir que hay 7 variables de decisión diferentes.

Por otro lado, hablando de las restricciones del problema dual, se observó que las restricciones presentan en su forma indexada ambos conjuntos S y H, por tanto, se puede concluir que la combinación de las cardinalidades de ambos conjuntos da 12 restricciones diferentes. Para finalizar es importante mencionar la naturaleza de las variables, donde se pueden ver igualmente 7 restricciones distintas gracias a la cardinalidad del primer grupo de variables de decisión w que es 3 y de las π que son 4, y al no estar asociadas entre sí, se puede decir que son la suma que da 7.

Escenario 1:

Se le recomienda al señor Jorge seleccionar la sucursal de Titán, esto se debe a que el problema que se presenta tiene una variable dual asociada que en el caso de aumentar la producción en un litro de helado en la sucursal de Titán se presentaría un cambio en los costos totales, minimizando la función objetivo, lo cual lo beneficiaría mucho más que escoger la sucursal de Usaquén, Salitre o Chico, ya que prometen un cambio de -2000 para las dos primeras y de 0 el último en la función objetivo, sin embargo, la variable relacionada con la sucursal de Titán tiene una promesa de disminuir en 3000 los costos totales, lo que sería mucho mejor para Jorge.

------------------ reescribir -----------------------------

Escenario 2:

Se le recomienda al señor Jorge no incrementar el requerimiento mínimo de vainilla, esto debido a que si lo aumenta va a generar un gasto de $2,000 COP, no va a haber ganancia alguna, ya que el costo que implica dicho cambio es de $32,000 COP, por tanto, no se justifica dicho cambio al señor Jorge.

------------------ reescribir -----------------------------

Problema 3 – Sensibilidad

a)

Variables de decisión:

Función Objetivo:

Maximizar la utilidad de la producción

Restricciones:

No excederse en la cantidad de tiempo destinado para la producción

No pasarse de la cantidad de coco disponible

No pasarse de la cantidad de almendra disponible

No pasarse de los litros de agua disponibles

No pasarse de la capacidad de producción

Naturaleza de las variables

b)

Gráfico, Gráfico de líneas

Descripción generada automáticamente

c)

Según el informe de sensibilidad de Excel, se puede afirmar que los valores de la capacidad de producción que hacen que la base siga siendo la misma base óptima son:

d)

Inicialmente conocemos los valores de las variables que indican los litros de bebida de coco y de almendra:

Necesitamos saber el problema en formato estándar, donde se puede observar de la siguiente manera:

s.a,

Dando como resultado de las variables en el óptimo lo siguiente:

De donde se puede obtener la siguiente información:

Donde necesitaremos un vector θ, el cual es un vector lleno de 0 a excepción de la posición en la que se encuentra la restricción asociada a la capacidad de producción:

En adición, será crucial encontrar la nueva base óptima en términos de de la siguiente forma:

Sabemos que la capacidad máxima para la producción actualmente es de 75 L, y según el rango de theta que se pudo observar anteriormente sabemos que si restamos 2.35 al valor de 75 L o sumamos un número muy grande(infinito), el rango de valores para la capacidad de producción es el mismo que se halló en el inciso c, el cual es:

Sin embargo, se debe tener en cuenta que esta restricción no se encuentra en la base en el rango delimitado, es decir que, aunque yo cambie los valores de la capacidad entre 72.65 L a infinto, no va a afectar en nada a la función objetivo ya que la restricción de producción no está activa y no está afectando la base.

e)