Geração de colunas

PL: $\min\limits_x \ c^t x$

s.a. $Ax = b$

$x \geq 0$

Escrevemos

$$A = \begin{bmatrix} A_1 \\ A_2 \end{bmatrix} \begin{matrix} (m_1 \times n) \\ (m_2 \times n) \end{matrix} \quad e \quad b = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \end{bmatrix}.$$

Assim

PL: $\min\limits_x \ c^t x$ s.a. $A_1 x = b_1$, $A_2 x = b_2$, $x \geq 0$

Seja $X = \{x \,;\, A_2 x = b_2 \,,\, x \geq 0\}$. Suponha $X \neq \emptyset$ e tome

- $x_1, \ldots, x_k$ pontos extremos de X;
- $d_1, \ldots, d_\ell$ direções extremas normalizadas de X.

O teorema de representação de poliedros permite escrever

$$X = \left\{ x = \sum_{j=1}^{k} \lambda_j x_j + \sum_{i=1}^{\ell} \mu_i d_i \;;\; \sum_{1}^{k} \lambda_j = 1, \; \lambda \geq 0, \mu \geq 0 \right\}$$

Assim,

$$\text{PL:} \quad \min_{\lambda, \mu} \; z = \sum_{j=1}^{K} (c^t x_j)\lambda_j + \sum_{i=1}^{\ell} (c^t d_i)\mu_i$$

$$\text{s.a.} \quad \sum_{j=1}^{K} (A_1 x_j)\lambda_j + \sum_{i=1}^{\ell} (A_1 d_i)\mu_i = b_1$$

$$\sum_{j=1}^{K} \lambda_j = 1$$

$$\lambda_j \geq 0 \;, \quad j = 1, \dots, K$$

$$\mu_i \geq 0 \;, \quad i = 1, \dots, \ell .$$

O PL anterior é chamado <u>problema mestre</u>. Observe que este PL está nas variáveis λ, μ, e a matriz dos coeficientes é

$$M = \begin{bmatrix} A_1 x_1 & \cdots & A_1 x_k & A_1 d_1 & \cdots & A_1 d_\ell \\ 1 & \cdots & 1 & 0 & \cdots & 0 \end{bmatrix} \cdot \left.\right\} \begin{matrix} m_1+1 \\ \text{linhas} \end{matrix}$$

Note que as restrições $A_2 x = b_2$ não estão mais presentes explicitamente. Por outro lado, não conhecemos $x_1, \ldots, x_k, d_1, \ldots, d_\ell \ldots$

Vamos pensar em resolver o problema mestre via Simplex. Para tanto, devemos calcular bases. Uma matriz básica associada à uma solução básica viável é uma matriz B inversível $(m_1+1)\times(m_1\times 1)$ cujas colunas são

$$\begin{bmatrix} Ax_j \\ 1 \end{bmatrix} \quad \text{e/ou} \quad \begin{bmatrix} Ad_i \\ 0 \end{bmatrix},$$

e $B^{-1}\begin{bmatrix} b_1 \\ 1 \end{bmatrix} \geq 0$.

De fato, note que as restrições do problema mestre, na forma padrão, são

$$M \begin{bmatrix} \lambda \\ \mu \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ 1 \end{bmatrix} , \quad \begin{bmatrix} \lambda \\ \mu \end{bmatrix} \geq 0 .$$

Então precisamos computar pontos extremos x_j e direções extremas d_i que participam da base do Simplex.

$\hookrightarrow$ computar <u>todos</u> x_j e d_i é impraticável !!!

Além disso, computar todos os pontos / direções extremas pode ser inútil, pois sabemos que o método Simplex geralmente percorre poucos vértices até convergir...

O que seria razoável fazer?

→ computar x_j ou d_i por demanda, isto é, quando já sabemos qual coluna entra na base!

O método de <u>geração de colunas</u> calcula uma coluna $\begin{bmatrix} A_1 x_j \\ 1 \end{bmatrix}$ ou $\begin{bmatrix} A_1 d_i \\ 0 \end{bmatrix}$ que entrará na base Simplex do problema mestre, através de um <u>problema auxiliar</u>, <u>sem explicitamente calcular todas as colunas.</u>

Esta estratégia é razoável desde que poucas colunas precisarem ser computadas.

Seja

$$B = \begin{bmatrix} A_1 x_{B_1} & \cdots & A_1 x_{B_p} & A_1 d_{B_{p+1}} & \cdots & A d_{B_{m_1+1}} \\ 1 & \cdots & 1 & 0 & \cdots & 0 \end{bmatrix}$$

uma base associado à uma solução básica viável do problema mestre

$$PL: \min_{\lambda,\mu} \; \bar{c}^t \begin{bmatrix} \lambda \\ \mu \end{bmatrix}$$

$$\text{s.a.} \; M \begin{bmatrix} \lambda \\ \mu \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ 1 \end{bmatrix}, \quad \begin{bmatrix} \lambda \\ \mu \end{bmatrix} \geq 0.$$

Aqui, $\bar{c}_j = c_j^t x_j$ ou $\bar{c}_j = c_j^t d_1$ são os custos.

- custos básicos:

$$\bar{C}_B = \left[\bar{C}_{B_1} \cdots \bar{C}_{B_{m_1+1}}\right]^t$$

$$= \left[c^t x_{B_1} \cdots c^t x_{B_p} \; c^t d_{B_{p+1}} \cdots c^t d_{B_{m_1+1}}\right]^t.$$

- custos não básicos:

$$\bar{c}_j = c^t x_j \quad \text{ou} \quad \bar{c}_j = c^t d_j \quad , \; j \in R.$$

- Para $j \in R$, $\bar{z}_j = \bar{c}_B^t B^{-1} \begin{bmatrix} A_1 x_j \\ 1 \end{bmatrix}$ ou $\bar{c}_B^t B^{-1} \begin{bmatrix} A_1 d_j \\ 0 \end{bmatrix}$.

Para decidir se B é ótima, devemos verificar se

$$\bar{z}_j - \bar{c}_j \leq 0, \quad \forall j \in R.$$

Porém, <u>não</u> queremos computar x_j ou d_j, $j \in R$, explicitamente! (pelo menos antes de decidir quem entra na base).

Escrevemos $\overline{c}_B^t B^{-1} = [u_1^t \ \ u_0]$, $u_1 \in \mathbb{R}^{m_1}$ e $u_0 \in \mathbb{R}$. Assim

- $$\overline{z}_j - \overline{c}_j = \overline{c}_B^t B^{-1} \begin{bmatrix} A_1 x_j \\ 1 \end{bmatrix} - c^t x_j = [u_1^t \ \ u_0] \begin{bmatrix} A_1 x_j \\ 1 \end{bmatrix} - c^t x_j$$

$$= (u_1^t A_1 - c^t) x_j + u_0$$

ou

- $$\overline{z}_j - \overline{c}_j = \overline{c}_B^t B^{-1} \begin{bmatrix} A_1 d_j \\ 0 \end{bmatrix} - c^t x_j = (u_1^t A_1 - c^t) d_j$$

Note que u_1 e u_0 são conhecidos do problema mestre. Então, para decidir se B é ótima podemos verificar se

- $$\max_{j=1,\dots,k} (A_1^t u_1 - c)^t x_j + u_0 \leq 0 \;;$$

- $$\max_{i=1,\dots,l} (A_1^t u_1 - c)^t d_i \leq 0 .$$

Combinando as inequações acima, obtemos

$$\max_{\substack{\lambda,\mu \geq 0 \\ \sum \lambda_j = 1}} (A_1^t u_1 - c)^t \left[\sum_j \lambda_j x_j + \sum_i \mu_i d_i \right] + \sum_j \lambda_j u_0 \leq 0$$

Lembrando que $x_1, \ldots, x_K$, $d_1, \ldots, d_l$ são pontos / direções extremas de

$$X = \{ x \; ; \; A_2 x = b_2 \; , \; x \geq 0 \} ,$$

o problema anterior é equivalente à

$$(PA) \quad \max_{y} \; (A_1^t u_1 - c)^t x + u_0$$

$$\text{s.a.} \quad A_2 x = b_2 \; , \quad x \geq 0 .$$

Este é o problema auxiliar (pricing problem).

Resolvendo o problema auxiliar pelo Simplex, três casos podem ocorrer:

1) Verificar que (PA) é ilimitado. Neste caso, teremos encontrado uma direção extrema d de X tal que $(A_1^t u_1 - c)^t d > 0$. Assim, a coluna $\begin{bmatrix} A_1 d \\ 0 \end{bmatrix}$ entra na base do problema mestre.

2) obter uma solução básica viável <u>ótima</u> x (vértice de X) tal que $(A_1^t u_1 - c)^t x + u_0 > 0$. Assim, a coluna $\begin{bmatrix} A_1 x \\ 1 \end{bmatrix}$ entra na base do problema mestre.

3) obter uma solução básica viável <u>ótima</u> x (vértice de X) tal que $(A_1^t u_1 - c)^t x + u_0 \leq 0$. Neste caso, B é ótima para

o problema mestre. Teremos os vetores λ e μ (variáveis do problema mestre) ótimos associados à B. Com eles, recuperamos a solução ótima do PL original fazendo

$$x = \sum_j \lambda_j x_j + \sum_i \mu_i d_i .$$

(aqui, x_j's e d_i's são associados à base B ótima, e estarão calculados).

Observações:

(i) decidido quem entra na base do problema mestre (e computada a coluna), a decisão de quem sai da base é a padrão:

λ_{B_r} ou μ_{B_r} que satisfaz

$$\frac{\bar{b}_r}{\bar{y}_{rj}} = \min\left\{\frac{\bar{b}_i}{\bar{y}_{ij}} \; ; \; \bar{y}_{ij} > 0\right\},$$

onde $\bar{b} = B^{-1}\begin{bmatrix} b_1 \\ 1 \end{bmatrix}$ e $\bar{y}_j = B^{-1}\begin{bmatrix} A_1 x_j \\ 1 \end{bmatrix}$ ou $B^{-1}\begin{bmatrix} A_1 d_j \\ 0 \end{bmatrix}$.

(ii) se não houver candidatos a sair, a conclusão é a padrão: problema mestre ilimitado, e logo PL ilimitado.

EXERCÍCIO: Resolver

$$
\begin{aligned}
\min \quad & z = x_1 + 2x_2 + x_3 + 2x_4 + 6x_5 \\
\text{s.a.} \quad & x_1 + x_2 - x_3 = 5 \\
& 4x_1 + x_2 - x_5 = 8 \\
& x_1 - 2x_2 + x_4 = 2
\end{aligned}
$$

por geração de colunas (veja livro Maculan/Fampa)

(iii) Veja que as restrições do problema auxiliar são $A_2 x = b_2$, $x \geq 0$, e devemos resolver vários desses problemas. Então:

- a técnica é adequada quando $A_2 x = b_2$ é simples (por exemplo, separável).

Uma situação comum e muito adequada para esta técnica é quando $A_2 x_2 = b_2$ é separável e $A_1 x_1 = b_1$ são restrições simples que acoplam os vários blocos separáveis:

acopla
$$A_{11}x^1 + A_{12}x^2 + A_{13}x^3 + \cdots + A_{1K}x^K \leq b_1$$

blocos $x^1, \ldots, x^K$
$$\begin{array}{lllll}
A_{21}x^1 & & & & \leq b_{21} \\
& A_{22}x^2 & & & \leq b_{22} \\
& & A_{23}x^3 & & \leq b_{23} \\
& & & \ddots & \vdots \\
& & & A_{2K}x^K & \leq b_{2K}
\end{array}$$

Problema auxiliar é separável (+ fáceis).

22

- a cada iteração do método de geração de colunas, uma nova coluna é requerida via resolução do problema auxiliar. As restrições do problema auxiliar são sempre $A_2 x = b_2$, $x \geq 0$, o que muda é a <u>função objetivo</u>. ~~Portanto~~ deve-se aproveitar a otimização feita na iteração anterior, reotimizando com poucas iterações primal Simplex.