Optimizacijske naloge

Optimizacijska naloga je $(\Omega, f, \max/\min/\sup/\inf,)$ kjer je:

- Ω množica dopustnih rešitev
- $f : \Omega \to \mathbb{R}$ kriterijska funkcija

$x^* \in \Omega$ je *optimalna* rešitev problema $(\Omega, f, \max)$, če velja

$$\forall x \in \Omega : f(x) \le f(x^*)$$

Optimizacijski problem

- Nedopustni $\Omega = \emptyset$
- Dopustni $\Omega \neq \emptyset$
  - Neomejen *kriterijska f. neomejena* $\max x$ p.p. $x \ge 0$
  - Omejen *kriterijska f. omejena*
    - Optimalni *zaprta meja* $\max x$ p.p. $0 \le x \le 1$
    - Neoptimalni *odprta meja* $\max x$ p.p. $0 \le x < 1$

Linearno programiranje

$(\Omega, f, \min/\max)$ je linearni porgram, če je Ω podana z linearnimi enakostmi in neenakostmi $(\le, \ge)$ in je f linearna.

Standardna oblika linearnega pograma

Linearni porgram je v *standardni* obliki, če iščemo max in so vsi pogoji neenakosti $\le$ in so vse spremenljivke nenegativne.

$$\begin{array}{ll} \max & c_1x_1 + \cdots + c_nx_n \\ \text{p.p.} & a_{11}x_1 + \cdots + a_{1n}x_n \le b_1 \\ & \vdots \\ & a_{m1}x_1 + \cdots + a_{mn}x_n \le b_m \\ & x_1, \ldots, x_n \ge 0 \end{array}$$

To lahko zapišemo v matrični obliki:

$$c = [c_1 \ldots c_n]^T \quad b = [b_1 \ldots b_m]^T \quad x = [x_1 \ldots x_n]^T$$

$$A = \begin{bmatrix} a_{11} & \ldots & a_{1n} \\ \vdots & & \vdots \\ a_{m1} & \ldots & a_{mn} \end{bmatrix} \in \mathbb{R}^{m \times n} \qquad \begin{array}{ll} \max & c^Tx \\ \text{p.p.} & Ax \le b \\ & x \ge 0 \end{array}$$

Vsak linearen program lahko zapišemo v standardni obliki.

Vse dele linearnega programa lahko preoblikujemo tako, da bodo v standardni obliki:

$$\min f(x) \rightsquigarrow \max(-f(x))$$
$$f(x) \ge b \rightsquigarrow -f(x) \le -b$$
$$f(x) = b \rightsquigarrow f(x) \le b \wedge f(x) \ge b$$
$$x_i \le 0 \rightsquigarrow x_i = -x_i'$$
$$x_i \gtrless 0 \rightsquigarrow x_i = x_i' - x_i'' \wedge x_i', x_i'' \ge 0$$

Konveksne množice

Množica $A \subseteq \mathbb{R}^n$ je *konveksna*, če velja:

$$\forall x, y \in A \ \forall \lambda \in [0,1] : (1-\lambda)x + \lambda y \in A$$

Daljica med poljibnima točkama iz A mora biti vsebovana v A.
Množica **ni** konveksna, če

$$\exists x, y \in A \ \exists \lambda \in [0,1] : (1-\lambda)x + \lambda y \notin A$$

Afina kombinacija:

$$\alpha_1x_1 + \cdots + \alpha_nx_n \qquad \alpha_1 + \cdots + \alpha_n = 1$$

Konveksna kombinacija:

$$\alpha_1x_1 + \cdots + \alpha_nx_n$$
$$\alpha_1 + \cdots + \alpha_n = 1 \qquad \alpha_1 + \cdots + \alpha_n \ge 0$$

Afin podprostor (= zaprt za afine kokmbinacije = premaknjen linearen prostor) je *konveksen.*

Presek konveksnih množic $A_i, \forall i \in I$ je konveksen.

Unija koknveksnih množic pa ni nujno konveksna.

Grafično reševanje linearnih programov

Za linearne porgrame z dvema spremenljivkama lahko narišemo območje, ki ga določajo pogoji. Nato izračunamo gradient kriterijske funkcije in premikamo v smeri gradienta proti točki, ki je v preseku polporostorov pogojev in čim dlje od izhodišča.

Simpleksna metoda

Linearni program zapišemo v standardni obliki. Če je kak $b_i < 0$, moramo uporabiti **dvofazno simpleksno metodo**, sicer nadaljujemo.

Linearni porgram zapišemo v *prvi* slovar.

$$\overbrace{\begin{array}{c} x_{n+1} = b_1 - a_{11}x_1 - \cdots - a_{1n}x_n \\ \vdots \\ x_{n+m} = b_m - a_{m1}x_1 - \cdots - a_{mn}x_n \\ \hline z = c_1x_1 + \cdots + c_nx_n \end{array}}^{\text{1. slovar}}$$

Vse spremenljivke $x_1, \ldots, x_{n+m}$ so nenegativne.

Spremenljivke na levi so **bazne**, na desni pa **nebazne**.

$x_1, \ldots, x_n$ ... **prvotne** spremenljivke

$x_{n+1}, \ldots, x_{n+m}$ ... **dopolnilne** spremenljivke

Slovar je **dopusten**, če so vse konstante (čelni brez x) na desni nenegativne.

Če je slovar dopusten, ima *bazno* dopustno rešitev: vse *nebazne* spremenljivke so 0 in kriterijska funkcija je tedaj $z = 0$.

- Določimo:
  - **vstopno spremenljivko**: izberem spremenljivko, ki ima v kriterijski funkciji pozitiven koeficient.
  - **pivotno vrstico**: enakost, ki povečanje vstopne spremenljivke najbolj omejuje. Če ni omejena, je problem **neomejen** in končamo.
  - **izstopno spremenljivko**: bazna spremenljivka v pivotni vrestici
- Iz pivotne vrstice izrazimo vstopno spremenljivko in pivotno vrstico zamenjamo z izražavo (vstopna spremenljivka gre v bazo na levo stran).
- V ostalih vrsticah in kriterijski funkciji vstopno spremenljivko nadomestimo z zgornjo izražavo.
- Dobimo naslednji slovar. Postopek ponavljamo dokler niso vsi koeficienti v kriterijski funkciji negativni ali enaki 0.

Iz zadnjega slovarja razberemo optimalne rešitve: spremenljivke, ki imajo v kriterijski funkciji negativen koeficient imajo vrednost 0, ostale pa lahko spreminjamo glede na omejitve.

Dvofazna simpleksna metoda

Če je $b \ngeq 0$, uporabimo dvofazno simpleksno metodo.

Prva faza

Konstruiramo pomožni problem. V vsaki neenakosti b_i prištejemo x_0. Kriterijsko funkcijo pa spremenimo v $\max -x_0$.

Iz pomožnega problema zapišemo 1. slovar.

$$\begin{array}{c} x_{n+1} = b_1 + x_0 - a_{11}x_1 - \cdots - a_{1n}x_n \\ \vdots \\ x_{n+m} = b_m + x_0 - a_{m1}x_1 - \cdots - a_{mn}x_n \\ \hline w = -x_0 \end{array}$$

Za vstopno spremenljivko izberemo x_0 za pivotno vrstico pa tisto v kateri je b_i najmanjši. Nato nadaljujemo z običajno simpleksno metodo.

Nadaljujemo z navadno simpleksno metodo in upoštevamo pravilo: x_0 ima prednost med kandidati za izstopno spremenljivko.

Če $w* < 0$, prvotni problem ni dopusten, sicer nadlajujemo z drugo fazo.

Druga faza

Iz zadnjega slovarja pomežnega problem izbrišemo x_0 in kriterijsko funkcijo originalnega programa izrazimo z nebaznimi spremenljivkami. Nadaljujemo z običajno simpleksno metodo.

Dualnost pri linearnem programiranju

Vsak linearni program P ima dualno obliko P':

$$\begin{array}{ll} \max & c^Tx \\ \text{p.p.} & Ax \le b \\ & x \ge 0 \end{array} \quad \Longrightarrow \quad \begin{array}{ll} \min & b^Ty \\ \text{p.p.} & A^Ty \ge c \\ & y \ge 0 \end{array}$$

$$P'' = P$$

Šibki izrek o dualnosti - ŠID

x dopustna rešitev za P, y dopustna rešitev za P' $\Longrightarrow$

$$c^Tx \le b^Ty$$

x dopustna za P, y dopustna za P' in $c^Tx = b^Ty$ $\Longrightarrow$

x optimalna rešitev P, y optimalna rešitevP'

Krepki izrek o dualnosti - KID

x^* optimalna rešitev P $\Longrightarrow$

optimalna rešitev P' in $c^Tx^* = b^Ty^*$

Linearni program in njegov dual sta lahko:

	nedopusten	neomejen	optimalen
nedopusten	✓	✓	//KID
neomejen	✓	//ŠID	//ŠID, KID
optimalen	//KID	//ŠID, KID	✓

Dualno dopolnjevanje

Naj bo x dopustna za P in y dopustna za P' tedaj je:

x optimalna za P in y optimalna za P' $\Longleftrightarrow$

$$\forall i = 1, \ldots, m : \quad \sum_{j=1}^{n} a_{ij}x_j = b_i \quad \text{ali} \quad y_i = 0$$

$$\forall j = 1, \ldots, n : \quad x_j = 0 \quad \text{ali} \quad \sum_{i=1}^{m} a_{ij}y_i = c_j$$

Ekvivalentno: x optimalna za P, y optimalna za P' $\Leftrightarrow$

$$\sum_{j=1}^{n} a_{ij}x_j < b_i \implies y_i = 0 \quad \forall i$$

in

$$x_j > 0 \implies \sum_{i=1}^{m} a_{ij}y_i = c_j \quad \forall j$$

Uporaba izreka o dualnem dopolnjevanju

Želimo dokazati, da je x^* optimalna rešitev linearnega programa P.

1. Preverimo, da je x^* dopustna rešitev.
2. Če je kakšna neenakost pri pogojih P izpolnjena s strogo neenakostjo, je pripadajoča dualna spremenljivka $y_i^* = 0$.
3. Če je kaka $x_j^* > 0$, je pripadajoča dualna neenakost v p' izpolnjena z enakostjo:
   $$\sum_{i=1}^{n} a_{ij}y_i = c_j$$
4. Vzamemo enačbe iz 3. koraka in upoštevamo, da so nekateri y iz 2. koraka enaki 0. Rešimo dobljeni sistem (če ni rešljiv, x^* ni optimalna).
5. Preverimo ali je dobljena rešitev y^* dopustna. Če je, sta x^* in y^* optimalni.

Dual splošnega problema

Splošna oblika linearnega programa je manj stroga standardna oblika. Dovolimo, da so pogoji postavljeni z $\le$ lahko pa tudi z $=$. Poleg tega dovolimo, da nekatere spremenljivke niso omejene z $x_j \ge 0$.

Program v splošni obliki izgleda takole:

$$\begin{array}{lll} \max & \sum_{j=1}^{n} c_jx_j & \\ \text{p.p.} & \sum_{j=1}^{n} a_{ij}x_i \le b_i & \forall i = 1, \ldots, m' \\ & \sum_{j=1}^{n} a_{ij}x_i = b_i & \forall i = m'+1, \ldots, m \\ & x_i \ge 0 & \forall i = 1, \ldots, n' \end{array}$$

Njegov dual pa je:

$$\begin{array}{lll} \min & \sum_{i=1}^{m} b_iy_i & \\ \text{p.p.} & \sum_{i=1}^{m} a_{ij}y_i \le c_j & \forall j = 1, \ldots, n' \\ & \sum_{i=1}^{m} a_{ij}y_i = c_j & \forall j = n'+1, \ldots, n \\ & y_i \ge 0 & \forall i = 1, \ldots, m' \end{array}$$

$$\text{enakost} \overset{\text{dual}}{\longleftrightarrow} \text{poljubna spremenljivka}$$

$$\text{neenakost} \overset{\text{dual}}{\longleftrightarrow} \text{nenegativna spremenljivka}$$

Dualno dopolnjevanje splošnega problema

x dopustna za P
y dopustna za P'
x optimalna za P in y optimalna za P' $\Leftrightarrow$

$$\forall i = 1, \ldots, m' : \quad \sum_{j=1}^{n} a_{ij}x_j = b_i \quad \text{ali} \quad y_i = 0$$

$$\forall j = 1, \ldots, n' : \quad x_j = 0 \quad \text{ali} \quad \sum_{i=1}^{m} a_{ij}y_i = c_j$$

Ekonomski pomen dualnih spremenljivk

Naj bo P linearni program, $\exists$ neizrojena optimalna rešitev (v zadnjem slovarju so vse konstante > 0). Potem $\exists \varepsilon > 0$, da velja

$$\Delta z^* = \sum_{i=1}^{m} y_i^* \Delta b_i$$

kjer je y^* optimalna rešitev duala, Δz^* sprememba optimalne vrednosti, Δb_i pa sprememba dense strani pogojev in $|\Delta b_i| < \varepsilon$.

Torej če desni strani pogojev v P prištejemo dovolj majhen Δb, se optimalna vrednost z^* programa P spremeni za $\Delta z^* = \Delta b^T y^*$.

$y*$ nam tedaj da "tržno ceno" dobrin. Če želimo povečati dobrino b_i, se nam dobiček poveča za $b_i y_i^*$. Torej za enoto dobrine i ne smemo plačati več kot y_i^*.

Matrične igre

Igro igrata 2 igralca. Prvi ima n, drugi pa m strategij.

Plačilna matrika A ima n vrstic in m stoplcev. Celica v i. vrstici in j. stolpcu predstavlja znesek, ki ga drugi plača prvemu, če prvi izbere strategijo i, drugi pa j. (Če je vrednost negativna, privi plača drugemu.)

Igralca igrata po principu najmanjšega tveganja: izbereta strategijo pri kateri v najslabšem primeru izgubita čim manj.

1. igralec: $\max_i \min_j a_{ij} =: M_1$

2. igralec: $\min_j \max_i a_{ij} =: M_2$

$$M_1 \leq M_2$$

(i_0, j_0) je **sedlo** plačilne matrike A, če je $a_{i_0 j_0}$ najmanjši v svoji vrstici in največji v svojem stolpcu.

$$A \text{ ima sedlo} \iff M_1 = M_2 = a_{i_0 j_0}$$

Če ima A sedlo, je i_0 optimalna strategija za prvega, j_0 pa za drugega igralca. V tem primeru je (i_0, j_0) *Nashevo ravnovesje* in nobenemu igralcu se ne splača spremeniti strategije.

Mešana strategija

Igralca svoje strategije izbirata nakjučno z verjetnostjo x_i oziroma y_j.

$$x = (x_1, \ldots, x_n) \quad x_1 \geq 0 \quad x_1 + \cdots + x_n = 1$$
$$y = (y_1, \ldots, y_n) \quad y_1 \geq 0 \quad y_1 + \cdots + y_m = 1$$

Matematično upanje je povprečno izplačilo, če bi igralca igrala veliko iger. Vsako celico v plačilni matriki pomnožimo z verjetnostjo, da bo prišlo do tega izida, in vrednosti seštejemo.

$$\sum_{i=1}^{n}\sum_{j=1}^{m} a_{ij} x_i y_j = \sum_{i=1}^{n}\left(\sum_{j=1}^{m} a_{ij} y_j\right) x_i = x^T A y$$

Če 1. igralec igra z neko mešano strategijo x, je

$$\min_y x^T A y = \min_{j=1,\ldots,m} \sum_{i=1}^{n} a_{ij} x_i$$

To pomeni, da se 2. igralec lahko na mešano strategijo optimalno brani z neko **čisto strategijo** $y = (0, \ldots, 1, \ldots, 0)$.

Iskanje optimalne strategije

Upoštevajoč, da se na mešano strategijo nasprotnik lahko brani z čisto strategijo, dobimo optimizacijska problema.

1. igralec išče $\max_x \min_y x^T A y = \max_x \min_{j=1,\ldots,m} \sum_{i=1}^{n} a_{ij} x_i$

2. igralec išče $\min_y \max_x x^T A y = \min_y \max_{i=1,\ldots,n} \sum_{j=1}^{m} a_{ij} y_j$

Problema zapišemo kot linerana programa.

1. igralec:

$$\begin{aligned} &\max && s \\ &\text{p.p.} && -\sum_{i=1}^{n} a_{ij} x_i + s \leq 0 \quad \forall j = 1, \ldots, m \\ &&& \sum_{i=1}^{n} x_i = 1 \\ &&& x_i \geq 0 \quad \forall i = 1, \ldots, n \end{aligned}$$

2. igralec:

$$\begin{aligned} &\min && t \\ &\text{p.p.} && -\sum_{j=1}^{m} a_{ij} y_j + t \geq 0 \quad \forall i = 1, \ldots, n \\ &&& \sum_{j=1}^{m} y_j = 1 \\ &&& y_j \geq 0 \quad \forall j = 1, \ldots, m \end{aligned}$$

Opazimo, da sta si linearna programa dualna. Oba problema sta optimalna in imata enako optimalno vrednost. To je **vrednost/streteško sedlo** igre.

Strategiji x^* in y^* sta optimalni $\iff$ sta dopustni in velja

$$\min_j \sum_{i=0}^{n} a_{ij} x_i^* = \max_i \sum_{j=1}^{m} a_{ij} y_j^*$$

Igra je **poštena** $\iff$ ima vrednost 0.

Igra je **simetrična**, če je $A = -A^T$. Tedaj ima vrednost 0 in je poštena.

Poenostavljanje plačilne matrike

Vektor x **dominira** x', če je $\forall i : x_i \geq x_i'$.

Če i. vrstica dominira i'. vrstico v plačilni matriki, lahko i'. vrstico odstranimo.
Če j. stoplec dominira j'. stolpec v plačilni matriki, lahko j. stolpec odstranimo.

S tem ne spremenimo optimalne vrednosti.

Problem razvoza

Imamo usmerjen graf $G = (V, E)$. G je povezan kot neusmerjen graf.

b_v ... poraba−proizvodnja v vozlišču $v \in V$
c_e ... cena povezave $e \in E$
x_e ... količina razvoza na povezavi $e \in E$

Poraba mora biti enako velika kot proizvodnja.

$$\sum_{v \in V} b_v = 0$$

Rešitev problema je vrednost razvoza za vsako povezavo x_e. Da je rešitev dopustna mora veljati

$$\forall e \in E: \ x_e \geq 0$$
$$\forall v \in V: \quad \sum_{\text{konec}(e)=v} x_e - \sum_{\text{začetek}(e)=v} x_e = b_v$$

Kriterijska funkcija je vsota cen, ki jih bomo plačali za razvoz. Seveda jo želimo minimizirati.

$$\sum_{e \in E} c_e x_e = c^T x$$

Za problem razvoza lahko zapišemo linearni program in njegov dual.

$$\begin{aligned} &\min && c^T x \qquad && \max && b^T y \\ &\text{p.p.} && Ax = b && \text{p.p.} && A^T y \leq c \\ &&& x \geq 0 \end{aligned}$$

Kjer je A incidenčna matrika

$$A = [a_{ve}]_{\substack{v \in V \\ e \in E}} \qquad a_{ve} = \begin{cases} 1 & \text{konec}(e) = v \\ -1 & \text{začetek}(e) = v \\ 0 & \text{sicer} \end{cases}$$

Rešitvi x in y optimalni $\iff$

$$\forall ij \in E: \qquad x_{ij} = 0 \quad \vee \quad y_j - y_i = c_{ij}$$

Simpleksna metoda na omrežjih

1. Poiščemo drevesno dopustno rešitev x
2. Rešimo $y_i + c_{ij} = y_j$ za $ij \in T$
   Začnemo s poljubnim vozliščem $y_1 = 0$ iz tega lahko izračunamo vrednosti za vsa ostala vozlišča tako, da se premikamo iz začetnega vozlišča in če gremo po pravi smeri, ceno razvoza povečujemo, sicer pa zmanjšujemo
   Če je $y_i + c_{ij} \geq y_j$ za $\forall ij \in E \setminus T$, je x optimalna rešitev - končamo.
3. Če je $y_i + c_{ij} < y_j$ za kak $ij \in E \setminus T$, je ij **vstopna povezava**. Dodamo jo v T in dobimo cikel.

   $$t = \min\{x_e : e \text{ obratna}\}$$

   Na premih povezavah cikla x povečamo za t, na obratnih pa pomanjšamo za t.
   Povezava na kateri je minimum dosežen, je **izstopna povezava** in jo odstranimo iz drevesa.
   Tako dobimo novo vpeto drevo in se vrnemo na korak 2.

Metoda se lahko zacikla. Ciklanju se izognemo tako, da izberemo koren $r \in V$ in za izstopno povezavo izberemo najbližjo r.

Dvofazna simpleksna metoda na omrežjih

Z njo poiščemo začetno drevesno rešitev oziroma dokažemo, da ne obstaja.

Skonstruiramo pomožen problem tako, da izberemo koren $r \in V$ in originalnemu porblemu dodamo povezave za $\forall v \in V$:

- če je $b_v \geq 0$, dodamo umetno povezamo rv (če še ne obstaja), razvoz $x_{rv} = b_v$, cena $c_v = 1$
- če je $b_v < 0$, dodamo umetno povezamo vr (če še ne obstaja), razvoz $x_{rv} = -b_v$, cena $c_v = 1$

Cene originalnih povezav nastavimo na 0.

Rešimo pomožen problem razvoza. Če dobimo rešitev s ceno 0 (ne uporablja pomožnih povezav), je originalni problem dopusten in končna drevesna rešitev pomožnega problema je dopustna drevesna rešitev za prvotni problem.

Če je proizvodnja večja kot poraba, problem ni rešljiv, a lahko dodamo **smetišče** z zadostno porabo in ga z brezplačnimi povezavami povežemo z vozlišči s proizvodnjo.

Celoštevilske rešitve

Za problem razvoza z $b_v \in \mathbb{Z}$ velja:

- če obstaja dopustna rešitev, obstaja tudi celoštevilska dopustna rešitev
- če obstaja optimalna rešitev, obstaja tudi celoštevilska optimalna rešitev

Königov izrek o plesnih parih

Dvojno stohastična matrika je matrika $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ za katero velja:

$$a_{ij} \geq 0 \qquad \forall i: \ \sum_{j=1}^{n} a_{ij} = 1 \qquad \forall j: \ \sum_{i=1}^{m} a_{ij} = 1$$

Permutacijska matrika je matrika $P \in \{0,1\}^{n \times n}$, ki ima v vsakem stolpcu in vrstici natanko eno 1.

Naj bo A dvojno stohastična matrika, potem obstaja premutacijska matrika P, da velja $p_{ij} > 0 \implies a_{ij} > 0$.

Königov izrek o plesnih parih

Naj bo G r-regularen graf, potem obstaja popolno prirejanje.

Problem razvoza z omejitvami

Imamo usmerjen graf $G = (V, E)$. G je povezan kot neusmerjen graf.

$b_v \in \mathbb{R}$ ... poraba−proizvodnja v vozlišču $v \in V$
$c_e \in \mathbb{R}$ ... cena povezave $e \in E$
$u_e \in [0, \infty]$ ... kapaciteta povezave $e \in E$
$x_e \in [0, u_e]$ ... količina razvoza na povezavi $e \in E$

Problem razvoza z omejitvami lahko zapišemo kot linearen program:

$$\begin{aligned} &\min && c^T x \\ &\text{p.p.} && Ax = b \\ &&& x \leq u \\ &&& x \geq 0 \end{aligned}$$

$x_e = 0 \quad \rightarrow \quad$ prazna povezava
$x_e = u_e \quad \rightarrow \quad$ nasičena povezava

Dopustna rešitev x je **drevesna dopustna rešitev**, če obstaja vpeto drevo T, da so vse povezave izven drevesa prazne ali nasičena.

Postopek reševanja

- Poiščemo začetno dopustno drevesno rešitev x z drevesom T
- Izračunamo ceno razvoza y za posamezna vozlišča
- Poiščemo vstopno povezavo $ij \notin T$, ki ustreza:
  - prazna: $x_{ij} = 0$, $y_i + c_{ij} < y_j \implies$ $t = \min(\{x_e : e \text{ obratna}\} \cup \{u_e - x_e : e \text{ prema}\})$ na premih povečamo za t, na obratnih pomanjšamo za t
  - nasičena: $x_{ij} = u_{ij}$, $y_i + c_{ij} > y_j \implies$ $t = \min(\{x_e : e \text{ prema}\} \cup \{u_e - x_e : e \text{ obratna}\})$ na premih pomanjšamo za t, na obratnih povečamo za t

Začetno dopustno drevesno rešitev poiščemo s pomožnim problemom:

Izberemo koren $r \in V$. Za vsako vozlišče v:

- $b_v < 0$ (proizvodnja): Če že obstaja povezava vr z kapaciteto $u_{vr} \geq -b_v$, nastavimo razvoz na tej povezavi na b_v, sicer dodamo povezavo vr z kapaciteto ∞ (dovolimo tudi več povezav med vozlišči).
- $b_v \geq 0$ (poraba): Če že obstaja povezava rv z kapaciteto $u_{rv} \geq b_v$, nastavimo razvoz na tej povezavi na $-b_v$, sicer dodamo povezavo rv z kapaciteto ∞.

Umetne (dodane) povezav imajo ceno 1, prvotne pa 0.
Prvotni problem je dopusten $\iff$ vrednost pomožnega problema enaka 0.