Material de apoyo Teórica XI

Temario

Análisis de sensibilidad

Problema Dual

Modificaciones a la solución óptima

- Modificaciones a los bi
 - o Rango de variación de un bi
 - o Gráfica de valor marginal
- Introducción de un nuevo producto
- Agregado de inecuaciones

Seguimos usando el problema de "FA CALDO":

2 X1 + 2 X2
$$\leq$$
 600 [KG AZUCAR/MES]
4 X2 \leq 600 [KG CREMA/MES]
2 X1 + 4 X2 \leq 800[KG ALMID./MES]

$$Z(MAX) = 8 X1 + 10 X2$$

TABLA OPTIMA

Solución con LINDO:

LP OPTIMUM FOUND AT STEP 2

OBJECTIVE FUNCTION VALUE

1) 2600.000

VARIABLE VALUE **REDUCED COST** X1 200.000000 0.000000 X2 100.000000 0.000000 ROW SLACK OR SURPLUS DUAL PRICES AZ) 0.000000 3.000000 CR) 200.000000 0.000000

NO. ITERATIONS= 2

0.000000

AL)

Solución del problema de los helados con GLPK

1.000000

Problem: FaCaldo Rows: 4 Columns: 2 Non-zeros: 7

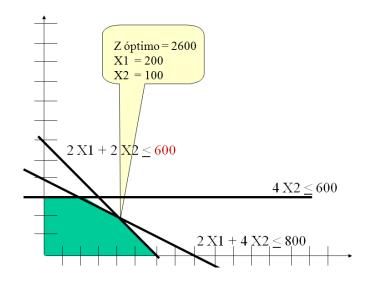
Status: OPTIMAL

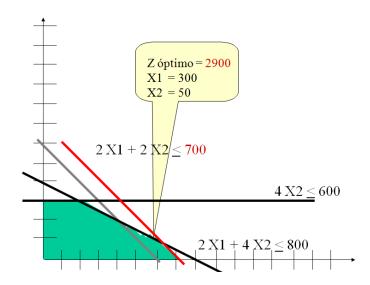
Objective: Z = 2600 (MAXimum)

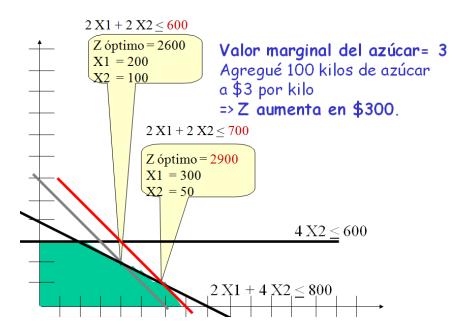
No.	Row name	St	Activity	Lower	bound	Upper	bound	Marginal	
2	Z AZUCAR CREMA ALMIDON	B NU B NU	2600 600 400 800				600 600 800		3
No.	Column name	St	Activity	Lower	bound	Upper	bound	Marginal	
_	X1 X2	B B	200 100		0				

Modificaciones a los bi

Ahora vamos a ver qué pasa cuando cambia la disponibilidad de un recurso. Supongamos que conseguimos 100 kilos más de azúcar. ¿Seguirá siendo igual el valor marginal del recurso? Si conseguimos más cantidad convendría que sí, sino lo que pensamos que valía mucho, pasa a valer poco (o nada)

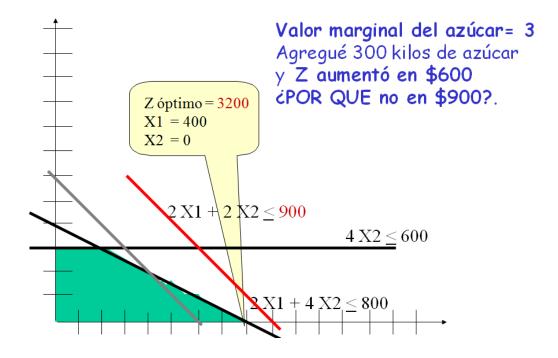






Como nos funcionó bien conseguir 100 kilos de azúcar (cada kilo nos aumentó el funcional en \$3 que es el valor marginal del azúcar), vamos a intentar aumentar más la disponibilidad del azúcar.

Vamos a conseguir 300 kilos adicionales a los que teníamos en un principio (que eran 600). Lo que esperamos es que cada kilo aumente el funcional en \$3, es decir que el Z pasará de valer 2600 a valer 3500



Lo que pasó fue que cuando conseguimos 200 kilos de azúcar llegamos al punto (400, 0) y al dejar de producir X2, no tenemos a quien quitarle almidón para agregarlo al azúcar que nos regalaron y no podemos hacer más producto X1

Por lo tanto, los 100 kilos restantes nos sobran (observen que la recta queda afuera del poliedro) y tienen valor marginal cero

Sería bueno que pudiéramos saber hasta cuánto conseguir para que se mantenga el valor marginal de \$3 para el recurso

Para saber eso tenemos que parametrizar el coeficiente de disponibilidad de azúcar (b₁) que actualmente vale 600

Si lo pudiéramos parametrizar podríamos hacer un trabajo parecido al que hicimos la clase anterior con los $c_{\rm j}$

El problema es que en la tabla óptima que nosotros tenemos no figura la disponibilidad de azúcar (figuraba en la primera tabla en la columna B, pero ya cambiamos la base varias veces)

Entonces tenemos que pasar de la expresión común del problema (que se llama expresión primal o directa) a otra expresión del problema, en la cual podamos parametrizar los términos independientes, que se llama PROBLEMA DUAL

El problema Dual

```
Dado un primal de la forma:
```

donde:

$$A(mxn)$$
 $B(mx1)$ $O(nx1)$ $X(nx1)$ $C(1xn)$

Se define como su problema Dual:

$$Y A \ge C$$

 $Y \ge 0$
min $Y B$

donde:

$$Y(1xm) \quad 0(1xm)$$

Relación entre Primal y Dual:

El dual tiene una variable real por cada restricción del problema primal.

El dual tiene tantas restricciones como variables reales tiene el primal.

El dual de un problema de maximización es un problema de minimización y viceversa.

Los coeficientes del funcional (costo o beneficio) del primal, son los términos independientes de las rest. del dual.

Los términos independientes de las rest. del primal son los coeficientes del funcional del dual.

Toda columna de coeficientes en el primal se transforma en una fila de coeficientes en el dual.

El sentido de las desigualdades del primal es el inverso del dual.

Hagamos el planteo inicial del dual de nuestro problema de los helados:

Directo inicial:

2 X1 + 2 X2 < 600

0 X1 + 4 X2 < 600

2 X1 + 4 X2 < 800

MAX Z = 8 X1 + 10 X2

Dual inicial:

2 Y1 + 0 Y2 + 2 Y3 > 8

2 Y1 + 4 Y2 + 4 Y3 > 10

MIN Z = 600 Y1 + 600 Y2 + 800 Y3

Relación entre las variables del Directo y las del Dual:

Sobrante de azúcar X3 - Y1 Valor marginal del azúcar

Sobrante de crema X4 - Y2 Valor marginal de la crema

Sobrante de almidón X5 - Y3 Valor marginal del almidón

Latas de hel. de agua X1 - Y4 Costo de oportunidad h. de agua Latas de hel. de crema X2 - Y5 Costo de oportunidad h. de crema

Observemos que las slack del directo se relacionan con las reales del dual y las reales del directo se relacionan con las slack del dual

Teorema fundamental de la dualidad:

Si el problema primal (o el dual) tiene una solución óptima finita, entonces el otro problema tiene una solución óptima finita y los valores de los dos funcionales son iguales.

Si cualquiera de los dos problemas tiene una solución óptima no acotada, entonces el otro problema no tiene soluciones posibles.

Teorema de la holgura complementaria.

Dados el problema primal y el dual correspondiente, siempre que en la k-ésima restricción de uno de ellos la variable de holgura o slack tome valor distinto de cero, entonces la k-ésima variable del otro problema desaparece de la base y, si la k-ésima variable de uno de los dos problemas es mayor que cero, en la k-ésima restricción del otro problema se verifica la igualdad (la variable slack o de holgura de esa restricción es igual a cero).

Consecuencia del teorema de la holgura complementaria:

Quiere decir que de cada par de variables directo-dual, una sola puede ser distinta de cero. Una sola de las dos está en la base de la tabla óptima de su problema.

$$0 = X3$$
 $Y1 = 3$
 $200 = X4$ $Y2 = 0$
 $0 = X5$ $Y3 = 1$
 $200 = X1$ $Y4 = 0$
 $100 = X2$ $Y5 = 0$

Pero entonces, si el valor del Z del directo en el óptimo, es igual al valor del Z del dual en el óptimo y además el valor de las variables del dual es igual al valor del zj-cj de su variable relacionada en el directo, en base a la tabla óptima del directo tendríamos que poder armar la tabla óptima del dual.

Las variables que están en la base en la tabla óptima del dual son aquellas cuya variable relacionada en el directo no estaba en la base en la tabla óptima del directo. Es decir que en la base óptima del dual estarán Y1 e Y3, porque X3 y X5 no estaban en la base en la óptima del directo.

- El valor que toman las variables en la óptima del dual es igual al zj-cj de su variable relacionada del directo. Es decir que Y1 vale 3, Y3 vale 1 y las demás valen cero.
- Tenemos que verificar que el Z nos dé 2600
- Y podemos armar los vectores canónicos, que van a ser los vectores de Y1 e Y3, que son las variables que están en la base.

			600	600	800		
Ck	Xk	Bk	A1	A2	А3	A4	<u> A5</u>
600	Y1	3	1		0		
800	Y3	1	0		1		
		2600	0		0		

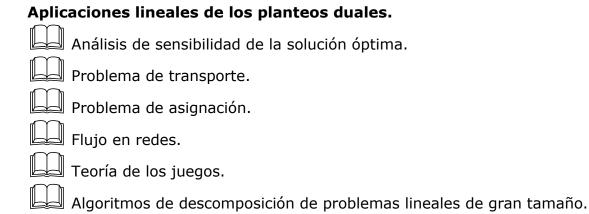
- El resto de los valores los vamos a sacar de los vectores no canónicos de la tabla óptima del directo, trasponiendo las columnas y cambiando el signo de los valores antes de pasarlos a la tabla del dual (les cambiamos el signo porque el dual opera con la identidad cambiada de signo, por ser un problema con restricciones de mayor o igual)
- Para saber dónde ubicar cada valor, colocamos en la tabla óptima del directo los nombres de las variables del dual relacionadas, debajo de cada columna y a la derecha de cada fila
- Hemos puesto un simbolito distinto en cada número para que se vea a dónde va a parar cada número de la tabla óptima del directo en la tabla óptima del dual.

TABLA OPTIMA DEL DIRECTO

		8	10				
<u>Ck</u>	Xk Bk	A1	A2	A3	A4	<u>A5</u>	
8	X1 200	1	0		0	-1/2	Y4
10	X2 100	0	1	$\frac{1}{2}$	0	1/2	Y5
0	X4 200	0	0	2>	1	(-2)	Y2
	2600	0	0	3	0	1	
		Y4	Y5	Y1	Y2	Y3	

TABLA OPTIMA DEL DUAL

600 600 800 **A2 A3** Ck Xk Bk Α1 0 600 Y1 3 1 1/2 1/2 800 Y3 -200 0 2600 0 -200 -100



Modificaciones al problema original

Modificaciones a los b_i

Ahora vamos a ver qué pasa cuando cambia la disponibilidad de un recurso. Es muy probable que no vayamos a fabricar la misma cantidad que antes. ¿Seguirá siendo igual el valor marginal del recurso? Si conseguimos más cantidad convendría que sí, sino lo que pensamos que valía mucho, pasa a valer poco (o nada)

Para analizar esto, necesitamos el DUAL

Rango de variación de un bi

Ahora queremos saber, para un determinado bi, dentro de qué rango puede variar su valor sin que la tabla óptima del dual deje de serlo. Los software de resolución también nos permiten responder esto.

Por ejemplo, en LINDO:

RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED:

OBJ COEFFICIENTRANGES

VARIABLE	CURRENT	ALLOWABLE	ALLOWABLE
	COEF	INCREASE	DECREASE
X1	8.000000	2.000000	3.000000
X2	10.000000	6.000000	2.000000

```
RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED:
RIGHTHAND SIDE RANGES
ROW CURRENT ALLOWABLE ALLOWABLE
```

RHS INCREASE DECREASE
AZ 600.000000 200.000000 100.0000000
CR 600.000000 INFINITY 200.000000
AL 800.000000 100.000000 200.0000000

Por supuesto el rango es válido si lo único que cambiamos es ese bi.

¿Y cuál es la base que no cambia?. A continuación vemos cuáles son los valores que no cambian:

LP OPTIMUM FOUND AT STEP

OBJECTIVE FUNCTION VALUE

1) 2600.000

\	/		
ED COST	REDUCE	VALUE	VARIABLE
0000	0.000	200.000000	X1
000	0.000	100.000000	X2
RICES	DUAL P	SLACK OR SURPLUS	ROW
000	3.000	0.000000	AZ)
000	0.000	200.000000	CR)
000	1.000	0.00000	AL)

NO. ITERATIONS= 2

RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED: OBJ COEFFICIENT RANGES

VARIABLE CURRENT ALLOWABLE ALLOWABLE COEF INCREASE DECREASE X1 8.000000 2.000000 3.000000 X2 10.000000 6.000000 2.000000

RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED:

RIGHTHAND SIDE RANGES ROW CURRENT ALLOWABLE ALLOWABLE RHS INCREASE DECREASE AZ 600.000000 200.000000 100.000000 CR 600.000000 INFINITY 200.000000 AL 800.000000 100.000000 200.000000

LP OPTIMUM FOUND AT STEP 2

OBJECTIVE FUNCTION VALUE 1) 2600.000

VARIABLE VALUE X1 200.000000 X2 100.000000 ROW SLACK OR SURPLUS 0.000000 AZ) CR) 200.000000 AL)

NO. ITERATIONS= 2

Cambios en los bi

Se presenta la posibilidad de conseguir 100 kilos adicionales de almidón que son regalados por el dueño del restaurante "Fideo Fino", cliente de la heladería.

¿Vale la pena considerar esta posibilidad?

En principio, el almidón está saturado (no tiene sobrante) por lo que convendría conseguir más. El valor marginal es 1, así que cada uno de los kilos que nos regalan nos da un peso de ganancia adicional, siempre que se mantenga el precio dual.

¿Cómo sabemos si se mantiene el precio dual?

Mirando el incremento permitido en la disponibilidad del recurso (allowable increase)

RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED:

OBJ COEFFICIENT RANGES						ODTIM	M FOUND AT OTED	0
VARIABL				ALLOWABLE	LP		IM FOUND AT STEP CTIVE FUNCTION VALU	2 E
X1	8.000	DEF INCRE 0000 2.0000		DECREASE 3.000000	1)	2600.0	000	
X2	10.000			2.000000	VA	RIABLE	VALUE	REDUCED COST
						X1	200.000000	0.000000
RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED:				X2	100.000000	0.000000		
F	RIGHTHAND	SIDE RANGES	50			ROW	SLACK OR SURPLUS	DUAL PRICES
ROW	CURRENT	ALLOWABLE INCREASE		OWABLE CREASE		AZ)	0.000000	3.000000
AZ	600.000000	200.000000		.000000		CR)	200.000000	0.000000
CR	600.000000	INFINITY		.000000		AL)	0.000000	1.000000
AL	800.000000	100.000000	200	.000000				

Como los 100 kilos están dentro del rango de aumento (justo son 100 como máximo), cada uno nos rinde 1 peso (nos aumenta el funcional en 1 peso).

Gráfica del VM del azúcar

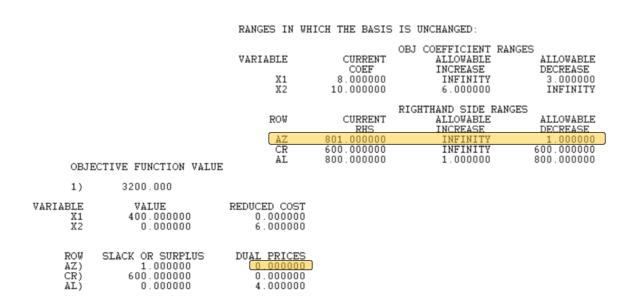
- ¿Cómo se hace el gráfico de valor marginal de un recurso?
- Para empezar, en la solución óptima, tenemos que obtener el rango de variación para el cual es válido ese valor marginal

 Así, se sigue hasta obtener los distintos rangos cuando la disponibilidad varía entre 0 e infinito

Empecemos por la solución óptima actual

RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED: OBJ COEFFICIENT RANGES VARIABLE CURRENT ALLOWABLE ALLOWABLE						M FOUND AT STEP TIVE FUNCTION VALU	2 IE
VAINIADEL	COEF	INCREASE	DECREASE	1)	2600.0	000	
X1	8.000000	2.000000	3.000000	VA	RIABLE	VALUE	REDUCED COST
X2	10.000000	6.000000	2.000000		X1	200.000000	0.000000
					X2	100.000000	0.000000
RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED:				ROW	SLACK OR SURPLUS	DUAL PRICES	
	HTHAND SIDE I URRENT ALLO		LOWABLE		AZ)	0.000000	3.000000
			ECREASE		CR)	200.000000	0.000000
AZ 60	0.000000 200.	000000 10	0.000000		AL)	0.000000	1.000000
			0.000000			500 <= b1 <= 8 abla es óptima	800

Ahora vamos a reemplazar b1 por un valor mayor que 800 para ver qué pasa de 800 para arriba

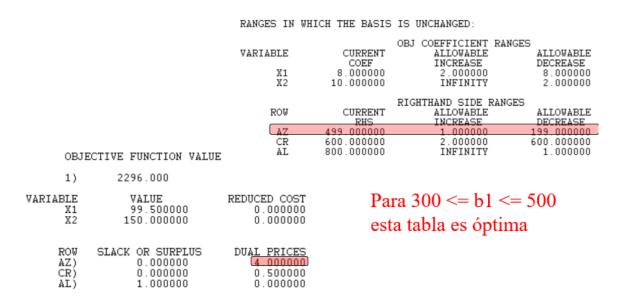


Eso quiere decir que para una disponibilidad de Azúcar mayor a 800 el valor marginal del azúcar pasa a ser cero

Ahora que ya sabemos qué pasa de 800 a infinito, volvamos a la solución óptima original

RANGES I	N WHICH THE B	ASIS IS UNCH	ANGED:	ΙP	OPTIMLIM F	FOUND AT STEP	2
	OBJ COEFFICI	ENT RANGES		OBJECTIVE FUNCTION VALUE			
VARIABLE	CURRENT	ALLOWABLE	ALLOWABLE	1)	2600.000		
	COEF	INCREASE	DECREASE	1)	2600.000		
X1	8.000000	2.000000	3.000000	VA	RIABLE	VALUE	REDUCED COST
X2	10.000000	6.000000	2.000000		X1	200.000000	0.000000
					X2	100.000000	0.000000
RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED:				ROW SL	ACK OR SURPLUS	DUAL PRICES	
	GHTHAND SIDE				AZ)	0.000000	3.000000
ROW (OWABLE CREASE		CR)	200.000000	0.000000
AZ 6	00.000000 200.	.000000 100	.000000		AL)	0.000000	1.000000
			0.000000			0 <= b1 <= 8 la es óptima	800

Ahora vamos a reemplazar b1 por un valor menor que 500 para ver qué pasa de 500 para abajo



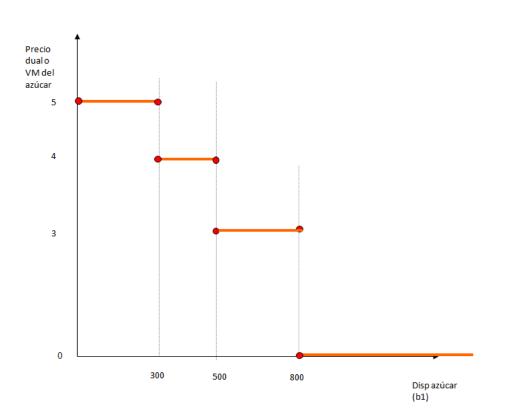
Ahora vamos a reemplazar b1 por un valor menor que 300 para ver qué pasa de 300 para abajo

RANGES IN WHICH THE BASIS IS UNCHANGED:

		OBJ COEFFICIENT RANGE	ES .
VARIABLE	CURRENT	ALLOWABLE	ALLOWABLE
	COEF	INCREASE	DECREASE
X1	8.000000	2.000000	INFINITY
X2	10.000000	INFINITY	2.000000
		RIGHTHAND SIDE RANGES	5
ROW	CURRENT	ALLOWABLE	ALLOWABLE
	RHS	INCREASE	DECREASE
AZ	299.000000	1.000000	299.000000
CR	600.000000	INFINITY	2.000000

OBJECTIVE FUNCTION VALUE

1) VARIABLE X1 X2	1495.000 VALUE 0.000000 149.500000	REDUCED COST 2.000000 0.000000	Para 0 <= b1 <= 300 esta tabla es óptima
ROW	SLACK OR SURPLUS	DUAL PRICES	
AZ)	0.000000	5.000000	
CR)	2.000000	0.000000	
AL)	202.000000	0.000000	



Con esto ya podemos resolver todos los ejercicios de la práctica 5.



Introducción de un nuevo producto

Ahora vamos a ver qué pasa cuando analizamos la posibilidad de fabricar un nuevo producto y no queremos resolver el problema de vuelta desde el principio.

Ante el peligroso aumento de la competencia se decide ofrecer una promoción de yogur helado a 8 \$/lata. Cada lata de yogur insume 1 kg. de almidón, 3 kg. de crema y 2 kg. de azúcar

```
2 X1 + 2 X2 + 2 X6 \leq 600 [KG AZ/MES]
4 X2 + 3 X6 \leq 600 [KG CR/MES]
2 X1 + 4 X2 + 1 X6 \leq 800[KG AL/MES]
Z(MAX) = 8 X1 + 10 X2 + 8 X6
```

X6: latas de yogur helado fab. por mes (latas/mes)

Estimación previa por el método del lucro cesante:

Lucro Cesante = ∑ UsoRecursoi * VMRecursoi

Lucro Cesante = 2 kgAZ/lata * 3 \$/kgAZ + 3 kgCR/lata * 0 \$/kgCR + 1 kgAL/lata * 1 \$/kgAL

LucroCesante = 7 \$/lata

Esto es una **estimación** del valor del Zj del nuevo producto.

¿El verdadero valor del Zj será mayor o menor que el Lucro Cesante?.

Será mayor o igual ¿por qué?

Porque como estamos cambiando más de un recurso a la vez, no podemos confiar en que el valor marginal se va a mantener (el rango de variación es válido cuando movemos un solo recurso). Y como estamos quitando recurso, si no se mantiene el valor marginal, aumenta.

Estimación previa por el método del lucro cesante:

- Si el lucro cesante es mayor que el beneficio del nuevo producto NO CONVIENE producir el nuevo producto
- Si el lucro cesante es menor o igual que el beneficio del nuevo producto PUEDE SER CONVENIENTE fabricar el nuevo producto
- Como en el caso de nuestro producto el lucro cesante es 7 y es menor o igual que el cj (que es 8) PUEDE SER CONVENIENTE fabricar el nuevo producto, así que vamos a tener que incorporarlo a la solución que hasta ahora es óptima, de manera de analizar su conveniencia sin hacer todo de nuevo.

Agregado de inecuaciones

- Ahora vamos a ver qué pasa cuando agregamos una restricción que antes no existía.
- Lo primero que tenemos que probar es si fabricando la misma cantidad cumplimos con la restricción.
- Si es así, la restricción nueva no afecta al óptimo actual (sigue siendo el óptimo).
- Si afecta, debemos analizar en el DUAL
- Se piensa en otra alternativa para hacer a la heladería más competitiva. Consiste en incorporar trozos de fruta a los helados. Se necesitan 4 kg. de fruta por lata de helado de agua y 3 kilos de fruta por cada lata de helado de crema. Se dispone de 1000 kg. de fruta mensuales

2 X1 + 2 X2 \leq 600 [KG AZUCAR/MES]

4 X2 ≤ 600 [KG CREMA/MES]

2 X1 + 4 X2 \leq 800[KG ALMID./MES]

4 X1 + 3 X2 < 1000[KG FRUTA/MES]

Z(MAX) = 8 X1 + 10 X2

Prueba de la restricción con la solución óptima actual:

 Antes de agregar la restricción, conviene probar con los valores actuales de X1 y X2 a ver si alcanza la disponibilidad del nuevo recurso fruta para seguir fabricando lo que hacíamos hasta ahora

4
$$X1 + 3$$
 $X2 <= 1000$
4 $200 + 3$ $100 = 1100$ que no es <= 1000

 Por lo tanto tenemos que agregar la nueva restricción: no podemos seguir produciendo lo mismo que hasta ahora (además sabemos que nos faltan 100 kilos)

¿Qué nos queda de esta clase?

- ☐ Seguimos viendo análisis de sensibilidad
 ☐ Problema Dual
 - lacksquare Modificaciones a la solución óptima
 - ☐ Cambios en un Bi
 - ☐ Gráfica de valor marginal
 - ☐ Introducción de un nuevo producto
 - ☐ Agregado de una nueva restricción