

1 Lezione del 23-09-24

1.1 Introduzione

1.1.1 Programma del corso

Il corso di ricerca operativa si divide in 4 parti:

1. Modello di Programmazione Lineare;
2. Programmazione Lineare su reti, ergo programmazione lineare su grafi;
3. Programmazione Lineare intera, ergo programmazione lineare col vincolo $x \in \mathbb{Z}^n$;
4. Programmazione Non Lineare.

Le prime 3 parti hanno come prerequisiti l'algebra lineare: in particolare operazioni matriciali, prodotti scalari, sistemi lineari, teorema di Rouché-Capelli. La quarta parte richiede invece conoscenze di Analisi II.

1.1.2 Un problema di programmazione lineare

La ricerca operativa si occupa di risolvere problemi di ottimizzazione con variabili decisionali e risorse limitate. Poniamo un problema di esempio:

Problema 1.1: Produzione

Una ditta produce due prodotti: **laminato A** e **laminato B**. Ogni prodotto deve passare attraverso diversi reparti: il reparto **materie prime**, il reparto **taglio**, il reparto **finiture A** e il reparto **finiture B**. Il guadagno è rispettivamente di 8.4 e 11.2 (unità di misura irrilevante) per ogni tipo di laminato.

Ora, nel reparto materie prime, il laminato A occupa 30, ore, e lo B 20 ore. Nel reparto taglio il laminato A occupa 10 ore e lo B 20 ore. Il laminato A occupa poi 20 ore nel reparto finiture A, mentre il laminato B occupa 30 ore nel reparto finiture B. I reparti hanno a disposizione, rispettivamente, 120, 80, 62 e 105 ore. Possiamo porre queste informazioni in forma tabulare:

Reparto	Capienza	Laminato A	Laminato B
Materie prime	120	30	20
Taglio	80	10	20
Finiture A	62	20	/
Finiture B	105	/	30
Guadagno		8.4	11.2

Quello che ci interessa è chiaramente massimizzare il guadagno.

Decidiamo di modellizzare questa situazione con un modello matematico.

Il guadagno che abbiamo dai laminati rappresenta una **funzione obiettivo**, ovvero la funzione che vogliamo ottimizzare. Ottimizzare significa trovare il modo migliore di massimizzare o minimizzare i valori della funzione agendo sulle variabili decisionali.

La funzione obiettivo va ottimizzata rispettando determinati **vincoli**, che modellizzano il fatto che le risorse sono limitate. Una **soluzione ammissibile** è una qualsiasi soluzione che rispetta i vincoli del problema. Chiamiamo quindi **regione ammissibile** l'insieme di tutte le soluzioni ammissibili. All'interno della regione ammissibile c'è la soluzione che cerchiamo, ovvero la **soluzione ottima**.

Decidiamo quindi le **variabili decisionali**, ed esplicitiamo la funzione obiettivo e i vincoli.

In questo caso le variabili decisionali saranno le quantità di laminato A e B da produrre, che individuano un punto in \mathbb{R}^2 denominato (x_A, x_B) . Decidere di usare la soluzione $(1, 1)$ significa decidere di produrre 1 unità di laminato A e 1 unità di laminato B, per un guadagno complessivo di $8.4 + 11.2 = 19.6$.

La funzione obiettivo sarà quindi:

$$f(x_A, x_B) = 8.4x_A + 11.2x_B, \quad f: \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$$

lineare, e noi saremo interessati a:

$$\max(f(x_A, x_B))$$

rispettando i vincoli, ergo nella regione ammissibile. Per esprimere questi vincoli, cioè il tempo limitato all'interno di ogni reparto, introduciamo il sistema di disequazioni:

$$\begin{cases} 30x_A + 20x_B \leq 120 \\ 10x_A + 20x_B \leq 80 \\ 20x_A + 0x_B \leq 62 \\ 0x_A + 30x_B \leq 105 \\ -x_A \leq 0 \\ -x_B \leq 0 \end{cases}$$

dove notiamo le ultime due disequazioni indicano la positività di x_A e x_B , in forma $f(x_A, x_B) \leq b$. Questo sistema non indica altro che la regione ammissibile.

Possiamo riscrivere questo modello usando la notazione dell'algebra lineare. La funzione obiettivo e i vincoli diventano semplicemente:

$$\begin{cases} \max(c^T \cdot x) \\ A \cdot x \leq b \end{cases}$$

dove c rappresenta il vettore dei costi, A rappresenta la matrice dei costi a b il vettore dei vincoli. c è trasposto per indicare prodotto fra vettori.

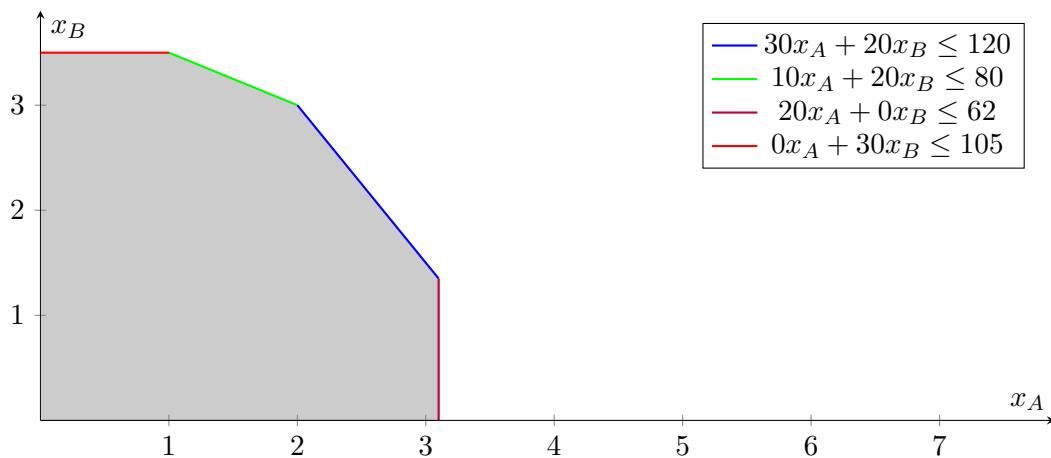
Possiamo scrivere A , b e c per esteso:

$$A: \begin{pmatrix} 30 & 20 \\ 10 & 20 \\ 20 & 0 \\ 0 & 30 \\ -1 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}, \quad b: \begin{pmatrix} 120 \\ 80 \\ 62 \\ 105 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, \quad c: \begin{pmatrix} 8.4 \\ 11.2 \end{pmatrix}$$

Notiamo come A e b hanno dimensione verticale $4 + 2 = 6$, dai 4 vincoli superiori e i 2 vincoli inferiori.

A questo punto, possiamo disegnare la regione ammissibile come l'intersezione dei semipiani individuati da ogni singola disuguaglianza.

Si riporta un grafico:



In diversi colori sono riportati i margini delle disequazioni, mentre in grigio è evidenziata la regione ammissibile. Qualsiasi punto all'interno della regione ammissibile vale come soluzione, e almeno uno di essi è soluzione ottimale.

Il modello finora descritto prende il nome di modello di programmazione lineare, e permette di formulare problemi di programmazione lineare (LP).

Definizione 1.1: Problema di programmazione lineare (1)

Un problema di programmazione lineare (LP) riguarda l'ottimizzazione di una funzione lineare in più variabili soggetta a vincoli di tipo $=$, \leq e \geq , ovvero in forma:

$$\begin{cases} \min / \max(c^T \cdot x) \\ A_i x \leq b \\ B_j x \geq d \\ C_k x = e \end{cases}$$

"Programmazione" qui non ha alcun legame col concetto di programmazione informatica, ma si riferisce al fatto che il modello è effettivamente *programmabile*.

"Lineare" si riferisce alla linearità dei problemi che ci permette di risolvere (e quindi del modello).

2 Lezione del 24-09-24

2.1 Forma primale standard

Ciò che abbiamo formulato finora è un problema di programmazione lineare. Possiamo dire che la forma:

$$\begin{cases} \max(c^T \cdot x) \\ Ax \leq b \end{cases}$$

rappresenta un problema LP in forma **primale standard**, ricordando che c è il vettore dei coefficienti della funzione obiettivo, A la matrice dei coefficienti per ogni vincolo, e b il vettore dei termini noti per ogni vincolo.

Definizione 2.1: Forma primale standard

Un problema di programmazione lineare si dice in forma primale standard quando è espresso in forma:

$$\begin{cases} \max(c^T \cdot x) \\ Ax \leq b \end{cases}$$

Si adotta una forma primale standard in quanto si può trasformare ogni problema LP in una forma di questo tipo.

2.1.1 Normalizzazione di un problema LP

Un modo per portare un problema LP qualsiasi in forma primale standard è:

1. Si trasformano le disuguaglianze: $\geq \leftrightarrow \leq$
2. Si riscrivono le uguaglianze come coppie di disequazioni:

$$f(x) = c \rightarrow \begin{cases} f(x) \leq c \\ f(x) \geq c \end{cases}$$

da cui la (1):

$$f(x) = c \rightarrow S \begin{cases} f(x) \leq c \\ -f(x) \leq -c \end{cases}$$

3. Se il problema richiede il minimo, si nota che $\max(f) = -\min(-f)$, e soprattutto:

$$\bar{x} \in \operatorname{argmax}(f) \Leftrightarrow \bar{x} \in \operatorname{argmin}(-f)$$

con $\operatorname{argmax}(f)$ e $\operatorname{argmin}(-f)$ rispettivamente gli insiemi dei punti di massimo e minimo. Questo significa che posso semplicemente cambiare di segno la funzione obiettivo per trovare da massimi minimi, e viceversa.

Notiamo inoltre che, nella forma primale standard, si ha:

$$x \in R^n, \quad A \in R^{n \times m}, \quad b \in R^m, \quad c \in R^n$$

2.2 Proprietà generali di un problema LP

La regione ammissibile di un problema PL si chiama **poliedro**. Si può dare agilmente una definizione algebrica di poliedro:

Definizione 2.2: Definizione algebrica di poliedro

Algebricamente, un poliedro è l'insieme delle soluzioni di un sistema di disequazioni lineari in \mathbb{R}^n variabili:

$$P = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax \leq b\}$$

Questa regione in un problema LP prende il nome di regione ammissibile.

Definizione 2.3: Definizione geometrica di poliedro

Geometricamente, un poliedro è l'intersezione di un numero finito di semispazi chiusi.

I semispazi chiaramente sono lineari, e in \mathbb{R}^2 rappresenterebbero semipiani. Chiusi significa che nelle disequazioni che descrivono i vincoli compaiono solo \leq e non $<$, ergo la regione ammissibile contiene la sua frontiera.

Possiamo dimostrare 4 proprietà dei poliedri:

1. Un'osservazione fondamentale è la seguente:

Teorema 2.1: Soluzione ottimale di un problema LP

La soluzione ottimale di un problema LP è contenuta nella frontiera della regione ammissibile.

Questo si può ricavare dai teoremi di Fermat e di Weierstrass, e dalla convessità della regione ammissibile. Inanzitutto, si è stabilito che la soluzione ottimale non è altro che il massimo o minimo assoluto all'interno della regione ammissibile del problema. Il gradiente della funzione obiettivo è $\neq 0$ in ogni suo punto (funzione lineare a gradiente costante). Da Fermat, i massimi e minimi hanno sempre gradiente 0, ergo massimi o minimi locali (che esistono per Weierstrass) possono trovarsi solo sulla frontiera. A questo punto, possiamo imporre la convessità per asserire che quei punti di massimo o minimo sono anche globali.

2. Prendiamo in esempio il poliedro dato da:

$$\begin{cases} x_A > 0 \\ x_B > 0 \end{cases}$$

o se vogliamo, in forma primale standard, dato dalle matrici A e b :

$$A : \begin{pmatrix} -1 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}, \quad b : \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

questo poliedro non è limitato nella direzione positiva, ergo può arrivare a valori di x_A e x_B che tendono a $+\infty$. Da ciò si ha che può accadere che un problema LP ammetta soluzioni x tali che $x \rightarrow \pm\infty$, ovvero che il poliedro sia illimitato. In particolare, un poliedro limitato si dice **politopo**.

3. Notiamo poi che la soluzione di un problema LP può non essere unica. Questo accade ad esempio quando la soluzione sta su un segmento di frontiera: a quel punto tutti i punti del segmento sono soluzione. Da questo segue che:

Teorema 2.2: Unicità della soluzione ottimale di un problema LP

Se un problema LP ha almeno 2 soluzioni, allora ne ha infinite.

Ciò si può dimostrare come segue. Si riporta innanzitutto la notazione parametrica del segmento zw , dati i due vettori di estremo z e w :

$$\lambda z + (1 - \lambda)w, \quad \lambda \in [0, 1]$$

A questo punto si pone che z e w sono entrambi soluzioni ottime, ergo:

$$\max(c^T \cdot x) = c^T z = c^T w = v$$

da cui si può dire che:

$$c^T (\lambda z + (1 - \lambda)w) = \lambda c^T z + (1 - \lambda)c^T w = \lambda v + (1 - \lambda)v = v$$

Ovvero ogni punto sul segmento porta la funzione obiettivo a massimo assoluto, quindi è soluzione ottimale.

4. Infine, notiamo che il poliedro della regione ammissibile di un problema LP può essere vuoto, ergo $P = \emptyset$. In questo caso, si ha che $\max(c^T \cdot x) = -\infty$ e $\min(c^T \cdot x) = \infty$. Un poliedro vuoto significa che i vincoli stessi vanno modificati. Questo solitamente si fa risolvendo una versione semplificata del problema LP.

Si può fare un'altro esempio per sottolineare l'importanza del punto di massimo (o minimo), e non quel massimo (o minimo). Finché nella funzione obiettivo i coefficienti compaiono nello stesso rapporto (ergo finché si scelgono vettori c linearmente dipendenti), il punto di massimo (o minimo) non cambia, per via della linearità (e si presume omogeneità) della funzione obiettivo stessa. Sarà solo il massimo (o minimo) a variare di un rapporto pari a quello di cui variano i coefficienti.

2.3 Gradiente e linee di isocosto

Si può dimostrare il seguente teorema:

Teorema 2.3: Gradiente della funzione obiettivo

Il gradiente di una funzione obiettivo definita come $f(x) = c^T \cdot x$ sulla base di un qualche vettore c è in ogni punto il vettore c stesso.

Da questo gradiente si possono ricavare le cosiddette linee di isocosto (in dimensioni > 2 sarebbero superfici), cioè linee a valore costante della funzione obiettivo.

Definizione 2.4: Linea di isocosto

Si definisce linea di isocosto di una funzione obiettivo con vettore c una retta (o superficie):

$$f(x) = c^T \cdot x = k$$

per un qualsiasi k costante.

2.4 Cono di competenza

Dovrebbe essere chiaro adesso che i punti di soluzione ottima stanno tutti su un segmento o su un punto della frontiera. Nel caso si abbia un vettore gradiente perpendicolare

ad un segmento della frontiera, quel segmento sarà soluzione ottima. In caso contrario, spostandoci a destra avremo l'estremo destro del segmento, e spostandoci a sinistra viceversa, finché non si diventerà perpendicolari a qualche altro segmento di frontiera.

Il cono (in R^2 , angolo) di valori possibili del gradiente che rendono un punto ottimale prende il nome di **cono di competenza**.

Definizione 2.5: Cono di competenza

Il cono di competenza di un punto x^* è il cono, ovvero l'insieme di vettori gradiente, tale per cui il punto x^* conserva l'ottimalità sulla funzione obiettivo coi vincoli imposti.

Vedremo in seguito l'importanza di una nozione di cono per i problemi LP.

3 Lezione del 25-09-24

3.1 Assegnamento di costo minimo

Vediamo un problema:

Problema 3.1: Assegnamento

Quattro agenzie possono occuparsi di 4 progetti. Ogni agenzia presenta il costo stimato per la realizzazione di ogni progetto, in migliaia di euro. In forma tabulare, si riportano i valori:

	Agenzia 1	Agenzia 2	Agenzia 3	Agenzia 4
Progetto 1	20	17	16	14
Progetto 2	22	16	19	15
Progetto 3	21	17	15	23
Progetto 4	19	18	14	24

Vogliamo capire quale agenzia deve occuparsi di quale progetto per minimizzare i costi.

Con n agenzie e progetti ci sono $n!$ possibili combinazioni, ergo dobbiamo trovare un algoritmo efficiente. Applicando il modello studiato finora, abbiamo la matrice dei costi c :

$$\begin{pmatrix} 20 & 17 & 16 & 14 \\ 22 & 16 & 19 & 15 \\ 21 & 17 & 15 & 23 \\ 19 & 18 & 14 & 24 \end{pmatrix}$$

che possiamo portare a:

$$c : (-18, +18 + \dots + 24)$$

come linearizzazione lessicografica della tabella sopra riportata (notare che sarebbe un vettore colonna).

Adesso dobbiamo solo trovare un metodo per esplicitare i vincoli del problema:

- Ogni agenzia può occuparsi solo di un progetto;

- Ogni progetto richiede solo un'agenzia.

Possiamo rappresentare la corrispondenza fra elementi come un grafo, e quindi riportarne una matrice d'adiacenza. Assumendo di appaiare elementi con lo stesso numero, avremo:

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

La caratteristica di questa matrice, chiamiamola x , e che ogni elemento x_{ij} è:

$$x_{ij} = \begin{cases} 0 \\ 1 \end{cases}$$

Decidiamo di trattare la x come un vettore linearizzato lessicograficamente dalla matrice, proprio come avevamo fatto per il vettore costo. Per una matrice di adiacenza $n \times n$, di n elementi in ogni categoria, questo vettore ha dimensione n^2 . Questo semplifica la notazione del problema, e soprattutto della matrice A , che sarebbe lasciando x matrice effettivamente un tensore.

Si dimostra quindi facilmente che i vincoli riportati prima possono quindi esprimersi come:

$$\begin{cases} x_{11} + x_{12} + x_{13} + x_{14} = 1 \\ x_{21} + x_{22} + x_{23} + x_{24} = 1 \\ x_{31} + x_{32} + x_{33} + x_{34} = 1 \\ x_{41} + x_{42} + x_{43} + x_{44} = 1 \end{cases}$$

per il primo punto, e:

$$\begin{cases} x_{11} + x_{21} + x_{31} + x_{41} = 1 \\ x_{12} + x_{22} + x_{32} + x_{42} = 1 \\ x_{13} + x_{23} + x_{33} + x_{43} = 1 \\ x_{14} + x_{24} + x_{34} + x_{44} = 1 \end{cases}$$

per il secondo. Imponendo la positività, si hanno quindi le matrici A e b :

$$A : \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & 0 & \dots & \dots & 0 \\ 0 & \dots & \dots & 0 & 1 & 1 & 1 & 0 & \dots & \dots & 0 \\ \dots & & & & & & & & & & \\ 0 & \dots & & & \dots & 0 & 1 & 1 & 1 & 1 & \\ \dots & & & & & & & & & & \\ -1 & 0 & \dots & & & & & & & \dots & 0 \\ \dots & & & & & & & & & & \\ 0 & \dots & & & & & & & & & -1 \end{pmatrix}, \quad b : (1, \dots, 1, 0, \dots, 0)$$

Si nota che il numero di vincoli necessari per n elementi è $2n + n^2$.

3.1.1 Assegnamento cooperativo e non cooperativo

A questo punto conviene fare una distinzione. Abbiamo definito finora il modello:

$$\begin{cases} \min c^T \cdot x \\ x_{11} + x_{12} + x_{13} + x_{14} = 1 \\ \dots \\ x_{41} + x_{42} + x_{43} + x_{44} = 1 \\ x_{11} + x_{21} + x_{31} + x_{41} = 1 \\ \dots \\ x_{14} + x_{24} + x_{34} + x_{44} = 1 \end{cases}$$

che così scritto non nega la possibilità di x con componenti reali. Nell'esempio ciò significa sono ammesse soluzioni dove più agenzie danno contributi reali ai progetti, che possiamo semanticamente interpretare come condividere il carico di lavoro, pur rispettando i vincoli imposti. Decidiamo che questo è corretto se si parla di un problema di **assegnamento cooperativo**. Visto che il problema posto non era di questo tipo, ma era di **assegnamento non cooperativo**, si introduce un'ulteriore vincolo:

$$x \in \mathbb{Z}^n$$

Adesso ogni azienda darà un contributo intero al suo progetto, ergo coi vincoli imposti prima, ogni azienda sarà unica nel dirigere un solo progetto.

Più formalmente, possiamo dire che il passaggio ad assegnamento cooperativo comporta un **rilassamento** dei vincoli del problema. Ovvero, in generale, se un problema non cooperativo ha minimo ottimale nc , il suo associato cooperativo avrà minimo ottimale c con:

$$c \leq nc$$

3.1.2 Forma primale standard

Portiamo quindi questo problema in una forma primale simile a quella vista per altri problemi LP, concesso il vincolo $x \in \mathbb{Z}^n$.

Finora avevamo usato le trasformazioni equivalenti per problemi LP:

1. Trasformazione delle disuguaglianze: $\geq \leftrightarrow \leq$
2. Trasformazione delle uguaglianze:

$$f(x) = c \rightarrow \begin{cases} f(x) \leq c \\ -f(x) \leq -c \end{cases}$$

3. Trasformazione minimo / massimo:

$$\max f = -\min f \text{ e soprattutto } \bar{x} \in \operatorname{argmax}(f) \Leftrightarrow \bar{x} \in \operatorname{argmin}(-f)$$

Possiamo applicare queste trasformazioni al modello, in particolare la (2), che porta il numero di vincoli a $4n + n^2$.

3.2 Introduzione di surplus

Vediamo un'ulteriore tecnica per trasformare problemi LP: si può portare una disequazione del tipo:

$$a_1x_1 + a_2x_2 + \dots + a_nx_n \leq b$$

in un'uguaglianza introducendo una variabile ausiliaria s :

$$a_1x_1 + a_2x_2 + \dots + a_nx_n + s = b$$

s prende il nome di **slack**, in italiano scarto, o *surplus*.

4 Lezione del 26-09-24

4.1 Geometria dei poliedri

Introduciamo progressivamente i tipi di **combinazione** che ci sono utili nello studio dei problemi di programmazione lineare.

4.1.1 Combinazioni lineari

Definizione 4.1: Combinazione lineare

Dati $x_1, x_2, \dots, x_k \in \mathbb{R}^n$ punti, y si dice **combinazione lineare** di x_1, x_2, \dots, x_k se:

$$\exists \lambda_i \quad (i = 1, \dots, k) \quad \text{t.c.} \quad y = \sum_{i=1}^k \lambda_i x_i$$

Le combinazioni lineari sono utili per esprimere la funzione obiettivo sulla base dei vettori costo, ma non bastano a trovarne una soluzione ottimale.

4.1.2 Combinazioni convesse

Si introduce quindi il concetto di:

Definizione 4.2: Combinazione convessa

Dati $x_1, x_2, \dots, x_k \in \mathbb{R}^n$ punti, y si dice **combinazione convessa** di x_1, x_2, \dots, x_k se:

$$\exists \lambda_i \in [0, 1] \quad (i = 1, \dots, k), \quad \sum_{i=1}^k \lambda_i = 1 \quad \text{t.c.} \quad y = \sum_{i=1}^k \lambda_i x_i$$

Possiamo dare un esempio di cos'è la combinazione convessa di due punti in \mathbb{R}^2 .
Posti x_1 e x_2 , si ha:

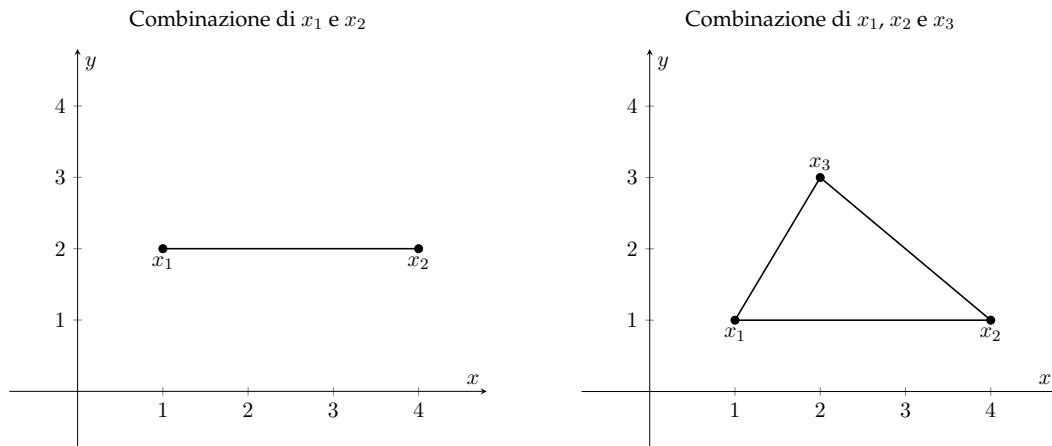
$$\lambda_1 + \lambda_2 = 1 \Rightarrow \lambda_2 = (1 - \lambda_1), \quad y = \lambda x_1 + (1 - \lambda)x_2, \quad \lambda \in [0, 1]$$

che riconosciamo essere l'equazione di un segmento x_1x_2 (primo grafico).

Possiamo provare con tre punti: si avrà:

$$y = \lambda_1x_1 + \lambda_2x_2 + \lambda_3x_3, \quad \lambda_1 + \lambda_2 + \lambda_3 = 1, \quad \lambda_i \in [0, 1]$$

che si riconduce all'equazione del triangolo di vertici x_1, x_2, x_3 (secondo grafico).



Dai grafici si nota come una combinazione convessa descrive una parte di spazio, che si può definire:

Definizione 4.3: Involucro convesso

L'involucro convesso $\text{conv}(K)$ di un'insieme di punti $K = \{x_1, x_2, \dots, x_n\}$, $x_i \in \mathbb{R}^n$ è definito come il luogo di tutte le loro combinazioni convesse.

Si nota che l'involucro convesso negli esempi precedenti è effettivamente un poliedro convesso che contiene tutti i punti che lo formano. Si può infatti dire:

Teorema 4.1: Minimalità dell'involucro convesso

L'insieme $\text{conv}(K)$ di tutte le combinazioni convesse di n punti è l'insieme convesso minimale che li contiene tutti.

In \mathbb{R}^n , possiamo esprimere un insieme convesso lineare come un poliedro convesso, e quindi dire che l'involucro convesso di n punti è il più piccolo (in termini di inclusione) poliedro convesso che li contiene tutti. Inoltre, un'insieme è convesso se e solo se corrisponde al suo involucro convesso.

Si noti che non è detto che a n punti corrisponda un poligono di n vertici. Potrebbe infatti accadere che uno dei punti (chiamiamolo x_j) sia già parte dell'involucro convesso, ergo $x_j \in \text{conv}(K)$.

Le combinazioni convesse ci permettono di descrivere parte delle regioni ammissibili (poliedri) dei problemi di programmazione lineare, ma restano ancora in sospeso problemi che ammettono regioni illimitate. Per descrivere tali regioni, si introduce un altro tipo di combinazione.

4.1.3 Combinazioni coniche

Definizione 4.4: Combinazione conica

Dati $x_1, x_2, \dots, x_k \in \mathbb{R}^n$ punti, y si dice **combinazione conica** di x_1, x_2, \dots, x_k se:

$$\exists \lambda_i \geq 0 \quad (i = 1, \dots, k) \quad \text{t.c.} \quad y = \sum_{i=1}^k \lambda_i x_i$$

La combinazione conica di più punti non è più il poliedro convesso che li contiene, ma il cono con vertice nell'origine, convesso o meno, che li contiene, definito come:

Definizione 4.5: Involucro conico

L'involucro conico $\text{cono}(K)$ di un'insieme di punti $K = \{x_1, x_2, \dots, x_n\} \in \mathbb{R}^n$ è definito come il luogo di tutte le loro combinazioni coniche.

Questo cono si estende fino all'infinito ($\lambda_i \geq 0$) nelle direzioni dei vettori che lo formano. Il concetto è simile a quello di spazio somma, ma con la differenza che non si va ovunque nello span dei due vettori, ma si seguono le semirette che essi conducono.

Si può dire, analogamente alle combinazioni convesse, che il cono di n punti è il più piccolo (in termini di inclusione) cono convesso che li contiene. Inoltre, un'insieme è un cono convesso se e solo se corrisponde al suo involucro conico.

4.2 Poliedri

Abbiamo definito un poliedro come la regione definita da un sistema di disequazioni lineari, o geometricamente come l'intersezione di un numero finito di semipiani chiusi in \mathbb{R}^n . Si dimostra che un poliedro, in quanto intersezione di insiemi convessi, è lui stesso convesso: potremo applicare la definizione di convessità per dire che, presi due punti $x_1, x_2 \in C$ nell'intersezione $C = C_1 \cap C_2$, si avrà che entrambi appartengono sia a C_1 che a C_2 , ergo il segmento che li congiunge completamente in ciascuno di quei due insiemi è interamente contenuto in C .

Un poliedro che è anche cono si chiama cono poliedrico. Si dimostra che:

Teorema 4.2: Cono poliedrico

Se P è un cono poliedrico allora:

$$\exists Q \quad \text{t.c.} \quad P = \{x \in \mathbb{R}^n : Qx \leq 0\}$$

con Q matrice.

Senza dimostrazioni, questo è chiaro dal fatto che le disequazioni che compongono il poliedrico sono omogenee (hanno frontiere che passano dall'origine).

Si definiscono poi i **vertici** del poliedro:

Definizione 4.6: Vertice

Un vertice di un poliedro è un punto che non si può esprimere come combinazione convessa propria di altri punti del poliedro. Si indica l'insieme dei vettori di un poliedro P come $\text{vert}(P)$.

Notiamo che i vertici di un poliedro limitato corrispondono ai punti che formano la combinazione convessa equivalente al poliedro. Per poliedri illimitati, introduciamo invece:

Definizione 4.7: Direzione di recessione

Un vettore d è la direzione di recessione di un poliedro se:

$$x + \lambda d \in P \quad \forall x \in P, \quad \forall \lambda \geq 0$$

Si indica come $\text{rec}(P)$ l'insieme delle direzioni di recessione di un poliedro.

Chiaramente, per ogni poliedro P , $0 \in \text{rec}(P)$ e per i poliedri limitati, $\text{rec}(P) = \{0\}$. Notiamo che le direzioni di recessione determinano i vettori del cono che coincide (almeno a distanze abbastanza grandi dall'origine) con i poliedri illimitati.

Inoltre, l'insieme $\text{rec}(P)$ di un poliedro è in sé un cono poliedrico. In particolare:

Teorema 4.3: Cono di recessione

Il cono di recessione di un poliedro P è dato da:

$$P = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax \leq b\} \Rightarrow \text{rec}(P) = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax \leq 0\}$$

Dimostrazione

Questo teorema vale perchè, per definizione, una direzione di recessione è $x + \lambda d$, che sostituita al sistema dà:

$$A(x + \lambda d) \leq b \Rightarrow Ax + \lambda Ad \leq b$$

Possiamo quindi sottrarre Ax da entrambi i lati:

$$\lambda Ad \leq b - Ax$$

Da ipotesi, $Ax \leq b$ e quindi $b - Ax \geq 0$. Chiamiamo questa quantità positiva k^+ e scriviamo:

$$\lambda Ad \leq k^+$$

Visto che $\lambda \rightarrow +\infty$, dovrà essere vero che $Ad \leq 0$, ergo con $d = x$, il teorema è dimostrato.

Un'altro teorema importante lega il cono ai suoi "raggi estremi", cioè quell'insieme finito di vettori la cui combinazione conica corrisponde all'intero cono:

Teorema 4.4: Raggi estremi

Un cono poliedrico $P = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax \leq 0\}$ è l'involucro conico di un'insieme limitato dei suoi punti. Questi punti prendono il nome di *raggi estremi*.

Dimostrazione

Diamo una dimostrazione più o meno intuitiva di questo risultato. Indichiamo con A_1, \dots, A_m le righe della matrice A . Queste formeranno dei vettori che indicano la direzione su cui "agisce" la disuguaglianza. Si può semplicemente osservare che questi vettori sono perpendicolari agli estremi del cono. Prendiamo quindi il cono dei vettori, che formerà un'altro cono detto *duale* del cono di partenza:

$$\text{cono}(A_1, \dots, A_m) = \{x \in \mathbb{R}^n : Qx \leq 0\}$$

I vettori Q_1, \dots, Q_t , presi come righe della matrice, sono perpendicolari ai vettori A_1, \dots, A_n di partenza, ergo paralleli ai raggi estremi del cono di partenza. Possiamo quindi dire che:

$$P = \text{cono}(Q_1, \dots, Q_t)$$

4.2.1 Spazio di linealità

Definiamo infine lo spazio di linealità:

Definizione 4.8: Spazio di linealità

Lo spazio di linealità di un poliedro illimitato P è il più piccolo sottospazio contenuto interamente in P .

Ogni vettore di base di uno spazio di linealità è un vettore d tale che:

$$d \in \text{rec}(P), \quad -d \in \text{rec}(P)$$

ovvero un vettore che è contenuto sia positivo che negativo nelle direzioni di recessione del poliedro.

Questa distinzione è importante in quanto non si può dimostrare completamente il prossimo teorema su poliedri con spazio di linealità $\neq 0$.

4.2.2 Teorema di rappresentazione dei poliedri

Gli strumenti che abbiamo stabilito finora ci permettono di enunciare un'importante risultato, noto come **teorema di rappresentazione dei poliedri**, o teorema di Minkowski-Weyl.

Teorema 4.5: Rappresentazione dei poliedri

Dato un poliedro P definito come $P = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax \leq b\}$, si ha:

$$\exists V = \{v_1, \dots, v_k\} \in \text{vert}(P), \quad \exists E = e_1, \dots, e_p \in \text{rec}(P) \quad \text{t.c.} \quad P = \text{conv}(V) + \text{cono}(E)$$

Questo significa che è possibile rappresentare qualsiasi poliedro attraverso i suoi vertici, e le direzioni in cui si estende all'infinito (ergo le sue direzioni di recessione).

4.2.3 H-rappresentazioni e V-rappresentazioni

Possiamo intendere il risultato precedente come segue: per ogni poliedro di un problema di programmazione LP, abbiamo due possibili rappresentazioni:

- **H-rappresentazione:** come intersezione di semispazi, ergo come insieme delle soluzioni di un sistema di disequazioni lineari.
- **V-rappresentazione:** come un'insieme di vertici e direzioni di regressione, quindi un involucro convesso e un cono di regressione.

Non diamo una dimostrazione del teorema ma possiamo, noti i concetti di H-rappresentazione e V-rappresentazione, dire che:

- Da un **H-rappresentazione** si può ricavare una **V-rappresentazione**: abbiamo un poliedro dato dall'H-rappresentazione $Ax \leq b$. Dividiamo questo poliedro in una parte limitata e una parte illimitata: la parte limitata sarà data dai vertici, mentre la parte illimitata sarà data dal cono di regressione:

$$P = \text{conv}(v_1, \dots, v_k) + \text{rec}(P)$$

A questo punto possiamo esprimere, come dallo scorso lemma, come combinazione conica dei suoi raggi estremi:

$$P = \text{conv}(v_1, \dots, v_k) + \text{cono}(e_1, \dots, e_p)$$

- Da un **V-rappresentazione** si può ricavare una **H-rappresentazione**: abbiamo un poliedro dato dalla V-rappresentazione $P = \text{conv}(v_1, \dots, v_k) + \text{cono}(e_1, \dots, e_p)$. Prendiamo separatamente gli involucri convessi e conici: avremo che per l'involucro convesso possiamo immediatamente riportare in una forma ad intersezione di semipiani (disequazioni):

$$\text{conv}(v_1, \dots, v_k) = \{x \in \mathbb{R}^n : A'x \leq b'\}$$

mentre per l'involucro conico possiamo portare in una forma ad intersezione di disequazioni omogenee:

$$\text{cono}(e_1, \dots, e_p) = \{x \in \mathbb{R}^n : A''x \leq 0\}$$

Per trovare l'H-rappresentazione, basterà combinare queste due rappresentazioni in una forma del tipo:

$$P = \{x \in \mathbb{R}^n : A'x \leq b', A''x \leq 0\}$$

La somma in $P = \text{conv}(V) + \text{cono}(E)$ si riferisce alla somma vettoriale fra tutti i possibili punti di $\text{conv}(V)$ e $\text{conv}(E)$, come quella studiata sui sottospazi vettoriali (anche se nessuno dei due insiemi è un sottospazio vettoriale). Per un dato insieme $\text{conv}(V)$, quindi, l'aggiunta di $\text{cono}(E)$ rappresenta la "proiezione" di tale insieme nelle direzioni di recessione indicate dal cono.

Più propriamente, posto $\text{lineal}(P) = 0$, si ha:

Teorema 4.6: Rappresentazione dei poliedri non lineali

Dato un poliedro P definito come $P = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax \leq b\}$, tale che $\text{lineal}(P)$, si ha:

$$P = \text{conv}(\text{vert}(P)) + \text{rec}(P)$$

la limitazione di linealità è necessaria in quanto un poliedro lineale potrebbe non essere rappresentato, nelle sue dimensioni infinite, dal semplice insieme dei suoi vettori. In verità, è possibile dimostrare che:

Teorema 4.7: Linealità di poliedri

Per ogni poliedro P non vuoto si ha:

$$\text{vert}(P) \neq \emptyset \Leftrightarrow \text{lineal}(P) = 0$$

ergo applicando lo scorso teorema potremmo provare a rappresentare un poliedro attraverso un'insieme di vettori vuoto.

Per i poliedri che otteniamo dai problemi di programmazione lineare, però, abbiamo i corollari:

- Un poliedro limitato è l'involucro convesso dei suoi vertici;
- Se il poliedro ha vincoli di positività sulle sue variabili, allora non è lineale, ergo si applica il teorema di rappresentazione. Questo è il tipo di poliedri a cui siamo abituati.

4.3 Teorema fondamentale della PL

Quanto riportare finora sulla geometria dei poliedri può essere usato per dimostrare il seguente teorema:

Teorema 4.8: Teorema fondamentale della PL

Sia dato un poliedro P rappresentato come:

$$P = \text{conv}(V) + \text{cono}(E), \quad V = \{v_1, \dots, v_k\}, \quad E = \{e_1, \dots, e_p\}$$

Se il problema \mathcal{P} con regione ammissibile P ha valore ottimo finito, allora esiste $s \in \{1, \dots, k\}$ tale che v_k è soluzione ottima di \mathcal{P} .

In sostanza, se un problema LP ha soluzione, essa si trova su uno dei vertici del poliedro della regione ammissibile.

Dimostrazione

Sia dato un problema LP \mathcal{P} in forma primale standard, ergo posto come:

$$\begin{cases} \max c^T \cdot x \\ Ax \leq b \end{cases}$$

ergo con regione ammissibile rappresentata da un poliedro P .

Dal teorema della rappresentazione, possiamo esprimere il poliedro come:

$$P = \text{conv}(V) + \text{cono}(E), \quad V = \{v_1, \dots, v_k\}, \quad E = \{e_1, \dots, e_p\}$$

Combiniamo le due equazioni, ergo esprimiamo prima il punto \bar{x} generico del poliedro applicando le definizioni di involucro convesso e conico:

$$\bar{x} \in P : P = \text{conv}(V) + \text{cono}(E), \quad \bar{x} = \sum_{i=1}^k \lambda_i v_i + \sum_{j=1}^p \mu_j e_j$$

ed esprimiamo quindi la funzione obiettivo come il prodotto scalare fra il vettore costo e il punto \bar{x} del poliedro:

$$c^T \cdot \bar{x} = c^T \cdot \left(\sum_{i=1}^k \lambda_i v_i + \sum_{j=1}^p \mu_j e_j \right) = \sum_{i=1}^k \lambda_i c^T v_i + \sum_{j=1}^p \mu_j c^T e_j$$

A questo punto conviene chiarire su cosa significa che il problema ha valore ottimo finito. Il secondo termine è la combinazione conica della sommatoria dei vettori di

recessione scalati dal vettore costo. Se almeno uno dei $c^T e_j > 0$, si avrà che portando $\mu_j \rightarrow +\infty$ la funzione avrà massimo $= \infty$. Geometricamente, questo significa che esiste una direzione illimitata del poliedro dove i vettori costo permettono alla funzione di crescere all'infinito.

Dunque sarà vero che $c^T e_j \leq 0 \quad \forall j \in \{1, \dots, p\}$ se vogliamo che la funzione abbia valore ottimo finito.

Possiamo quindi usare questa ipotesi per dire:

$$\begin{aligned} c^T \cdot \bar{x} &= \sum_{i=1}^k \lambda_i c^T v_i + \sum_{j=1}^p \mu_j c^T e_j \leq \sum_{i=1}^k \lambda_i c^T v_i \leq \sum_{i=1}^k \max_{1 \leq i \leq p} (\lambda_i c^T v_i) \\ &= \left(\max_{1 \leq i \leq p} c^T v_i \right) \sum_{i=1}^k \lambda_i = \max_{1 \leq i \leq p} c^T v_i = c^T v_k \end{aligned}$$

E quindi $\max_{x \in P} c^T \cdot x \leq c^T v_k$. A questo punto, visto che \bar{x} è effettivamente un punto della regione ammissibile, sarà vero che:

$$c^T v_k \leq \max_{x \in P} c^T \cdot x$$

E dunque $\max_{x \in P} c^T \cdot x = c^T v_k$, come volevasi dimostrare.

5 Lezione del 30-09-24

5.1 Calcolo dei vertici

Troviamo adesso il modo di calcolare i vertici del poliedro di un problema LP in forma primale standard.

Avevamo già dato la definizione di vertice come punto non ottenibile come combinazione convessa degli altri punti del poliedro (definizione 4.6). Questa definizione è corretta ma poco utile per il calcolo procedurale. Dimostriamo quindi un teorema utile.

Innanzitutto, assumiamo che in generale, per un problema LP \mathcal{P} con n variabili decisionali e m vincoli, si ha che $n < m$. A questo punto, possiamo dire:

Definizione 5.1: Soluzione di base primale

Sia dato un problema LP \mathcal{P} in forma primale standard con $n < m$. Sia $B \subseteq \{1, \dots, m\}$ un sottoinsieme di indici di riga tale che $\text{card}(B) = n$. A questo punto, sia A_B la sottomatrice di A con con righe indicate da B , e b_B il sottovettore colonna di B con righe indicate da B , con $\det A_B \neq 0$. Allora la soluzione di:

$$A_B x = b_B$$

è detta soluzione di base primale di \mathcal{P} .

da qui possiamo dimostrare il teorema:

Teorema 5.1: Caratterizzazione dei vertici primali

Su un problema in forma primale standard, un punto x del poliedro P è un vertice di P se e solo se è una soluzione di base primale ammissibile, ovvero:

$$x \in \text{vert}(P) \Leftrightarrow x \text{ è soluzione di base primale}$$

Riflettiamo un'attimo su questo risultato: se la definizione di vertice era effettivamente sufficiente a dichiarare *quali* erano i vertici, un teorema di caratterizzazione come quello sopra riportato ci fornisce una procedura per calcolarli tutti a partire da P . In questo, definizione e teorema di caratterizzazione sono effettivamente intercambiabili, ovvero:

$$\text{definizione} \Leftrightarrow \text{teorema di caratterizzazione}$$

6 Lezione del 01-10-24

6.1 Soluzioni di base primali degeneri

Abbiamo dato un teorema di caratterizzazione dei vertici primali. Questo teorema si basava sulla nozione di **soluzione di base primale**. Possiamo fare una distinzione fra soluzione di base degeneri e non degeneri:

Definizione 6.1: Soluzione di base degenera

Quando una soluzione di base è soluzione di più combinazioni delle disequazioni del problema, essa si dice degenera.

Questa definizione è esatta ma non particolarmente utile. Sostanzialmente, ci dice soltanto che una soluzione degenera è **ridondante** su più combinazioni di disequazioni (cioè risolve $A_B x = b_B$ su più permutazioni degli $1, \dots, m$ elementi in classi n in B). Si noti che ridondante non significa **eliminabile**: questa affermazione purtroppo è vera soltanto in R^2 , dove effettivamente si può rimuovere una delle disequazioni ridondanti ed avere sempre lo stesso risultato.

Diamo quindi una caratterizzazione delle soluzioni di base primali degeneri appoggiandoci al teorema di caratterizzazione dei vertici, ergo al concetto di soluzione di base:

Teorema 6.1: Caratterizzazione delle soluzioni di base primali degeneri

Se una soluzione è di base, ergo scelto $B = \{1, \dots, m\}$ con $\text{card}(B) = n$ è data da $A_B x = b_B$, possiamo dire che è pure degenera quando $\exists i \in N$ t.c. $A_i x = b_i$, con $I = \{1, \dots, m\} - B$.

Quindi, una soluzione di base è degenera quando almeno una variabile di base si annulla per almeno una delle disequazioni non di base indicate dagli indici I , che sono tutti gli indici fra $\{1, \dots, m\}$ non contenuti in B .

Sulla stessa linea di pensiero, possiamo dimostrare un'altro teorema, stavolta sul concetto piuttosto intuitivo di ammissibilità. Potremmo infatti dire che una soluzione di base ammissibile, cioè che rientra all'interno della regione ammissibile, è tale se:

Teorema 6.2: Caratterizzazione delle soluzioni di base primali ammissibili

Se una soluzione è di base, ergo scelto $B = \{1, \dots, m\}$ con $\text{card}(B) = n$ è data da $A_B x = b_B$, possiamo dire che è ammissibile quando $\forall i \in N$ si ha $A_i x \leq b_i$, con $I = \{1, \dots, m\} - B$.

cioè banalmente rispetta tutte le disequazioni.

6.1.1 Considerazioni numeriche sui numeri di soluzioni base

Solitamente un problema con n variabili decisionali a $m \geq n$ vincoli. Posti questi vincoli, visto che per calcolare $\text{vert}(P)$ prendiamo effettivamente tutte le combinazioni degli m vincoli classe n variabili decisionali, possiamo usare il coefficiente binomiale per calcolare il numero massimo di potenziali vertici:

$$\text{card}(\text{vert}(P)) \sim \binom{m}{n} = \frac{m!}{n!(m-n)!}$$

In verità, i vertici sono solitamente meno, in quanto possiamo rimuovere le soluzioni non ammissibili. Inoltre, le soluzioni degeneri non contribuiscono al risultato, ergo anche quelle non sono rilevanti.

6.2 Riassunto delle trasformazioni equivalenti

Riassumiamo adesso le trasformazioni equivalenti che abbiamo individuato finora per le disequazioni di problemi LP:

- $\min(C^T \cdot x) \leftrightarrow \max(C^T \cdot x)$: trasformiamo problemi di massimo in problemi di minimo invertendo i segni;
- $Ax \geq b \leftrightarrow -Ax \leq -b$: invertiamo il verso della disequaglianza moltiplicando per -1 ;
- $Ax = b \rightarrow Ax \leq b \wedge Ax \geq b$: convertiamo un'uguaglianza in una coppia di disequaglianze;
- $Ax \leq b \rightarrow Ax + s = b$: convertiamo una disequaglianza in un'uguaglianza introducendo una variabile di surplus. Si nota che la variabile di surplus può essere riconosciuta per essere rimossa, da:
 - $s > 0$;
 - Compare in un solo vincolo, che è di uguaglianza;
 - Ha coefficiente 0 nella funzione obiettivo, e 1 nell'equazione dove compare;
- $x \geq 0 \rightarrow x = x^+ - x^-$, $x^+ \geq 0$, $x^- \geq 0$: aggiriamo il vincolo di positività introducendo parti positive e negative delle variabili decisionali, con rispettivi vincoli di positività.

Usiamo queste trasformazioni per portare i problemi LP in forme standard. Esistono molteplici forme standard, ma in questo corso ci riguardano: il formato *linprog*, usato dal pacchetto software *MATLAB*, le forme standard primale (già vista) e duale (che vedremo fra poco).

7 Lezione del 02-10-24

7.1 Trasporto

Poniamo il seguente problema:

Problema 7.1: Trasporto

Due centrali del latte di Firenze producono rispettivamente 50 e 60 mila litri di latte al giorno. Le centrali servono tre quartieri, che consumano rispettivamente 30, 30 e 20 mila litri di latte al giorno. Si conosce il costo necessario per portare un migliaio di litri di latte da ogni centrale a ogni quartiere, riportato nella seguente tabella:

	Novoli	Statuto	Rifredi
Centrale A	6	8	4
Centrale B	7	3	9

Vogliamo capire quanto latte deve spedire ogni centrale ad ogni quartiere.

Nota simpatica: secondo l'indagine INRAN-SCAI 2005-06, l'italiano medio consuma 0.115g di latte al giorno, che per un peso specifico di circa 1.040kg/L fanno 0.11L di latte al giorno. Al 2024, il comune di Firenze ha 364 073 abitanti, ergo dovrebbe avere bisogno di approssimativamente 40 258L di latte al giorno. I fiorentini nell'esempio devono avere le ossa veramente forti!

Possiamo esprimere il problema dell'esempio come un problema LP. Abbiamo innanzitutto che i costi di trasporto formano una matrice:

$$C_{matr} = \begin{pmatrix} 6 & 8 & 4 \\ 7 & 3 & 9 \end{pmatrix}$$

che possiamo linearizzare, come avevamo fatto nei problemi di assegnamento di costo minimo, in un vettore costo:

$$C = (6, 8, 4, 7, 3, 9)$$

Questo vettore moltiplica il vettore delle variabili decisionali, che è la linearizzazione della matrice:

$$x_{matr} = \begin{pmatrix} x_{13} & x_{14} & x_{15} \\ x_{23} & x_{24} & x_{25} \end{pmatrix}$$

Questa matrice non rappresenta altro che quanto latte mandare ad ogni quartiere.

A questo punto, possiamo stabilire i vincoli. Innanzitutto, non si può avere più latte di quanto viene prodotto, ergo:

$$\begin{cases} x_{13} + x_{14} + x_{15} \leq 50 \\ x_{23} + x_{24} + x_{25} \leq 60 \end{cases}$$

inoltre, si vuole fornire ad ogni quartiere il fabbisogno richiesto, ergo:

$$\begin{cases} x_{13} + x_{23} \geq 30 \\ x_{14} + x_{24} \geq 30 \\ x_{15} + x_{25} \geq 20 \end{cases}$$

Questo è un problema di programmazione lineare.

In generale, quindi, un problema di trasporto minimizza la funzione obiettivo data da una matrice di costo in $n \times m$ variabili, con m vincoli di riga sul vettore o_j dei limiti di produzione, e n vincoli di colonna sul vettore d_j della domanda, in forma:

$$\begin{cases} \min \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n c_{ij} x_{ij} = C^T \cdot x \\ \sum_{i=1}^m x_{ij} \geq d_j \quad \forall j = 1, \dots, n \\ \sum_{j=1}^n x_{ij} \leq o_i \quad \forall i = 1, \dots, m \\ x \geq 0 \end{cases}$$

Non ci sono soluzioni se la domanda supera l'offerta, cioè se:

$$\sum_{j=1}^m d_j \geq \sum_{i=1}^m o_i$$

Mentre in caso di eccessi di produzione, potremmo trasformare le disequaglianze in eguaglianze, e aggiugnere un carico "fittizio" con costo zero dove deviare il surplus di produzione.

Inoltre, come avevamo detto per i problemi di assegnamento di costo minimo, anche qui potremmo scegliere di distinguere fra trasporti divisibili (nel campo $x = \mathbb{R}^n$) e indivisibili (col vincolo aggiunto $x = \mathbb{Z}^n$).

7.2 Forma duale standard

Avevamo definito la forma primale standard:

$$\begin{cases} \max C^T \cdot x \\ Ax \leq b \end{cases}$$

Introduciamo adesso la forma duale standard:

Definizione 7.1: Forma duale standard

Un problema di programmazione lineare si dice in forma duale standard quando è espresso in forma:

$$\begin{cases} \min(c^T \cdot x) \\ Ax = b \\ x \geq 0 \end{cases}$$

7.2.1 Vertici del duale

Sulle forme duali è semplice il calcolo dei vertici. Possiamo infatti avere, come avevamo fatto sulla primale:

Definizione 7.2: Soluzione di base duale

Sia dato un problema LP \mathcal{P} in forma duale standard. Sia $B \subseteq \{1, \dots, n\}$ un sottoinsieme di indici di variabili decisionali tale che $\text{card}(B) = m$. Chiamiamo x_B l'insieme delle variabili decisionali individuate da B , e x_N l'insieme delle $n - m$ variabili decisionali rimanenti:

$$x = \{x_B, x_N\}$$

Impostiamo quindi tutte le x_N a 0: avremo un sistema di m variabili in m equazioni, quindi determinato. La soluzione di quel sistema è detta soluzione di base duale di \mathcal{P} .

Indichiamo spesso questo vertice come $(bA_B^{-1}, 0)$. Questa definizione porta ad una caratterizzazione dei vertici del tutto analoga a quella dichiarata sui problemi in forma primale standard:

Teorema 7.1: Caratterizzazione dei vertici duali

Su un problema in forma duale standard, un punto x del poliedro P è un vertice di P se e solo se è una soluzione di base duale ammissibile, ovvero:

$$x \in \text{vert}(P) \Leftrightarrow x \text{ è soluzione di base duale}$$

7.2.2 Soluzioni di base duali degeneri

Possiamo ricavare il concetto di soluzione degenera (e anche di soluzione ammissibile) sui vertici del poliedro del duale. Si ha:

Teorema 7.2: Caratterizzazione delle soluzioni di base duali degeneri

Se una soluzione è di base, ergo scelto $B = \{1, \dots, n\}$ con $\text{card}(B) = m$ è data da $(bA_B^{-1}, 0)$, possiamo dire che è pure degenera quando $\exists i \in B$ tale che almeno una componente si annulla.

e riguardo l'ammissibilità:

Teorema 7.3: Caratterizzazione delle soluzioni di base duali ammissibili

Se una soluzione è di base, ergo scelto $B = \{1, \dots, n\}$ con $\text{card}(B) = m$ è data da $(bA_B^{-1}, 0)$, possiamo dire che è ammissibile quando il vettore soluzione è ≥ 0 .

8 Lezione del 03-10-24**8.1 Teoria della dualità**

Introduciamo adesso uno dei concetti più importanti della programmazione lineare. Avevamo posto problemi LP in forma primale standard come:

$$\begin{cases} \min(c^T \cdot x) \\ Ax \leq b \end{cases}$$

Ottimizzare questo problema significa partire dal basso e avvicinarsi verso un punto di massimo. Potremmo scegliere di seguire il percorso opposto: cercare di estrapolare un limite superiore per la soluzione dai vincoli, e minimizzarlo.

Per fare ciò introduciamo m variabili, una per ogni disequazione, che denoteremo come y_1, \dots, y_m . Moltiplichiamo ogni disequazione per la y_i corrispondente a destra e a sinistra. Su un semplice problema $n, m = 2$, questo darà una forma del tipo:

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 \leq b_1 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 \leq b_2 \end{cases} \rightarrow \begin{cases} y_1 \cdot (a_{11}x_1 + a_{12}x_2) \leq b_1 y_1 \\ y_2 \cdot (a_{21}x_1 + a_{22}x_2) \leq b_2 y_2 \end{cases}$$

Se vincoliamo gli y_i in modo che ogni variabile decisionale x_i del sistema abbia un coefficiente del costo $\geq c_i$ corrispondente, otterremo una disequazione che ha a sinistra una situazione di valore uguale o addirittura migliore di quella data dalla funzione costo, e a destra un massimo (che era ciò che stavamo cercando, un limite superiore). Abbiamo quindi una serie di variabili vincolate:

$$\begin{cases} y_1 a_{11} + y_2 a_{21} \geq c_1 \\ y_1 a_{12} + y_2 a_{22} \geq c_2 \end{cases}$$

e una funzione da minimizzare:

$$\min(b_1 y_1 + b_2 y_2)$$

Cioè, ci siamo ricondotti ad un altro problema LP. Possiamo formalizzare questo risultato:

Definizione 8.1: Duale di un problema LP

Per un qualsiasi problema LP \mathcal{P} , detto primale, con $m \geq n$, possiamo definire il duale \mathcal{D} :

$$P : \begin{cases} \max(c^T \cdot x) \\ Ax \leq b \end{cases} \rightarrow D : \begin{cases} \min(b^T \cdot y) \\ A^T y = c \\ y \geq 0 \end{cases}$$

dove si nota $x \in \mathbb{R}^n$ e $y \in \mathbb{R}^m$.

Il duale viene posto in forma duale standard in quanto ciò che ci interessa è *stringere* il limite superiore fino al suo minimo, in un modo che fa combaciare perfettamente le variabili con il loro vettore costo, da cui le uguaglianze.

Si può dimostrare che l'operazione del calcolo del duale è involutoria: il duale del duale è nuovamente il primale, e così via.

8.1.1 Dualità debole

Visto che abbiamo costruito il duale per avere un limite superiore dei valori ottenuti dalla funzione obiettivo del primale, potremo dimostrare facilmente:

Teorema 8.1: Dualità debole

Se i poliedri P e il suo duale D non sono vuoti, allora:

$$c^T x \leq y^T b \quad \forall x \in P, \forall y \in D$$

Cioè il duale è sempre maggiore del primale.

8.1.2 Dualità forte

Idealmente, ciò che vorremmo è che primale e duale convergessero verso un punto comune, ergo l'ottimo di entrambi. Effettivamente, questo risultato è verificato:

Teorema 8.2: Dualità forte

Se i poliedri P e il suo duale D non sono vuoti, allora:

$$-\infty \leq \min_{y \in D} b^T y = \max_{x \in P} c^T x \leq +\infty$$

Il teorema della dualità forte afferma che, se entrambi i poliedri (primale e duale) sono non vuoti, allora condividono l'ottimo, e anzi, che due soluzioni nel primale e nel duale sono ottime solo se hanno lo stesso valore. Se invece solo il primale (solo il duale) è vuoto, si ha che entrambi condividono ottimo $-\infty$ ($+\infty$). Quando entrambi sono vuoti non si ha soluzione condivisa.

Si noti che la dualità è univocamente determinata solo nel caso di soluzioni non degeneri. Nel caso di soluzioni degeneri si può avere che a una soluzione del primale ne corrispondono multiple del duale, e viceversa. In questo caso, è possibile che si raggiunga un massimo (o un minimo) nel primale (nel duale), a partire da più vertici complementari, o addirittura senza che la soluzione di base complementare sia ammissibile. Più formalmente, se l'esistenza di una soluzione complementare ammissibile è **condizione necessaria e sufficiente** per problemi con soluzioni non degeneri, è solo **condizione sufficiente** per problemi con soluzioni degeneri.

Ad esempio, si noti il problema duale:

$$\begin{cases} \min 3y_1 - 7y_2 + 5y_3 + 22y_4 + 14y_5 + 15y_6 \\ -y_1 - y_2 + 3y_4 + 2y_5 + 2y_6 = 2 \\ y_1 - 4y_2 + y_3 + 2y_4 + y_5 - 2y_6 = 1 \\ ey_i \geq 0 \end{cases}$$

con il primale associato:

$$\begin{cases} \max 2x_1 + x_2 \\ -x_1 + x_2 \leq 3 \\ -x_1 - 4x_2 \leq -7 \\ x_2 \leq 5 \\ 3x_1 + 2x_2 \leq 22 \\ 2x_1 + x_2 \leq 14 \\ 2x_1 - 2x_2 \leq 5 \end{cases}$$

Con la base $B = \{1, 5\}$, si hanno le soluzioni $\bar{x} = (4, 5)$ e $\bar{y} = (0, 0, 0, 0, 1, 0)$. Si dimostra che \bar{y} è ottima a D , mentre \bar{x} è non ammissibile su P . Ciò deriva dal fatto che \bar{y} in D è degenere: descrive un vincolo perpendicolare al vettore costo (di indice $i = 5$), e quindi soddisfatto da infinite soluzioni del primale. Il punto \bar{x} nel primale ha come complementare l'ottimo del duale perchè sta proprio su questo vincolo.

8.1.3 Scarti complementari

Si può dimostrare il seguente teorema:

Teorema 8.3: Scarti complementari

Se le soluzioni x e y dei problemi primale e duale \mathcal{P} e \mathcal{D} sono entrambe ottime, allora vale:

$$y^T(b - Ax) = 0$$

Questo si ricava dal fatto che, per la dualità forte, si ha che:

$$c^T x = y^T Ax = y^T b \Rightarrow y^T(b - Ax) = 0$$

Il significato del teorema è che, se una disequazione nel primale è *stretta*, allora la corrispondente variabile nel duale è $\neq 0$, e viceversa.

8.1.4 Soluzioni di base

Avevamo dato una definizione di soluzione di base per problemi LP in forma sia primale che duale. Possiamo dimostrare che non solo questa nozione esiste su entrambe le formule, ma è analoga su coppie primale / duale.

Avevamo posto che la formazione di una certa base $B \in \{1, \dots, m\}$ per ricavare soluzioni di base. Per il primale, questo significa partizionare la matrice e i termini noti:

$$A = \begin{pmatrix} A_B \\ A_N \end{pmatrix}, \quad b = \begin{pmatrix} b_B \\ b_N \end{pmatrix}$$

mentre per il duale, significherà partizionare le variabili introdotte:

$$y = \begin{pmatrix} y_B \\ y_N \end{pmatrix}$$

noto il numero di y_1, \dots, y_m uguale a m .

Questo significa che possiamo trovare due soluzioni di base corrispondenti per un'unica base su primale e duale. Queste sono:

- Soluzione di base primale: $x = A_B^{-1}b_B$;
- Soluzione di base duale: $y_B^T = c^T A_B^{-1}$, $y_N = 0$;

Si dice che le soluzioni di base sono **complementari**.

Dimostrazione Vogliamo che $y^T(b - Ax)$ sia = 0 soddisfatte le condizioni di base. Appliciamo quindi la base:

$$\begin{aligned} y^T(b - Ax) &= (y_B^T, y_N^T) \begin{pmatrix} b_B - A_B x \\ b_N - A_N x \end{pmatrix} = (c^T A_B^{-1}, 0) \begin{pmatrix} b_B - A_B A_B^{-1} b_B \\ b_N - A_N A_B^{-1} b_B \end{pmatrix} \\ &= (c^T A_B^{-1}, 0) \begin{pmatrix} 0 \\ b_N - A_N A_B^{-1} b_B \end{pmatrix} = 0 \end{aligned}$$

Questo nome non è a caso, in quanto si può dimostrare le due soluzioni sono in scarti complementari. Da questo risultato, si ha che se entrambe le soluzioni sono ammissibili, cioè:

- La primale è ammissibile:
- $$\forall i \in N \text{ si ha } A_i x \leq b_i$$

ergo i vincoli sono soddisfatti;

- La duale è ammissibile:

$$y \geq 0$$

questo è condizione sufficiente perché la soluzione sia ottima, e dagli scorsi corollari, sia l'ottima sia del primale che del duale.

Formalizziamo quanto detto in un teorema:

Teorema 8.4: Condizioni di ottimalità di soluzione di base

Dato un vertice del primale, ottenuto da una certa base, si può costruire il complemento duale sulla stessa base. Se entrambi i vertici ottenuti sono ammissibili, allora sono uguali e ottimi dei rispettivi problemi.

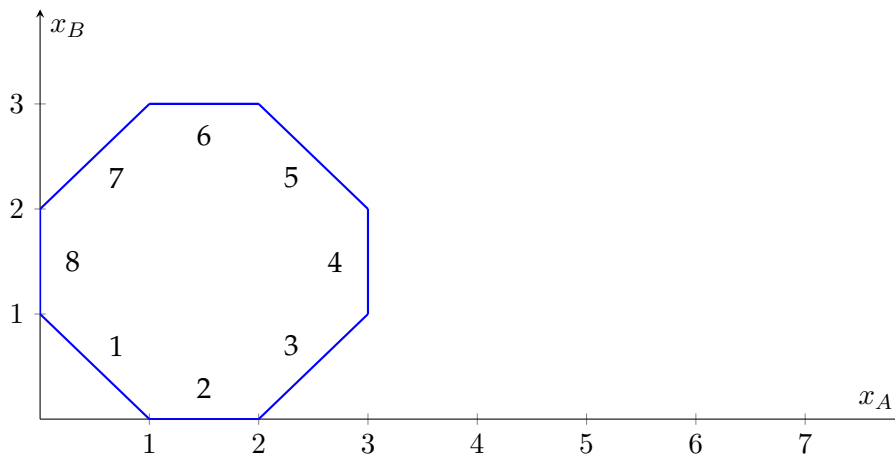
9 Lezione del 07-10-24

9.1 Algoritmo del simplesso primale

Supponiamo di avere un problema LP in formato primale standard con $n = 8$ vincoli, espresso come:

$$\begin{cases} \max(c^T \cdot x) \\ Ax \leq b \end{cases}$$

e con poliedro:



Scegliamo un vertice di partenza, per adesso ad arbitrio: diciamo $\bar{x} = (0, 1)$ (vedremo in seguito un'algoritmo particolare per ricavare un vertice, che ci permetterà anche di determinare se il poliedro è vuoto o meno). Ci chiediamo se questo vertice \bar{x} è ottimo. Visto che è vertice, abbiamo che per una matrice A_B e un vettore b_B di base:

$$\bar{x} = A_B^{-1}b_B$$

e che possiamo costruire il complementare duale \bar{y} , impostando a zero le variabili fuori base e risolvendo il sistema:

$$\bar{y} = (cA_B^{-1}, 0)$$

e applicare il test di ottimalità, cioè vedere se:

$$cA_B^{-1} \geq 0$$

ergo $\bar{y} \in D$, quindi il complementare duale esiste e il vertice è ottimo. Se questa condizione risulta verificata, possiamo fermarci, in quanto abbiamo trovato la soluzione ottimale.

In caso contrario, avremo $\exists k \in B$ tale che $\bar{y}_k < 0$. Dovremo quindi spostarci verso un'altro vertice, magari *adiacente*, che dal punto di vista delle basi, significa cambiare un solo indice di base, conservando gli altri. Possiamo formalizzare questa affermazione definendo un **indice uscente** h ed un **indice entrante** k . Sostituire un indice di base significa effettuare il cambio di base:

$$B := B \setminus \{h\} \cup \{k\}$$

Resta la domanda di *quale* spigolo scegliere: in uno spazio vettoriale \mathbb{R}^n , ho a disposizione n spigoli che si staccano dallo stesso vertice. Ovviamente, vorrei scegliere uno spigolo che accresce la funzione obiettivo, e si può dimostrare che ne esiste almeno uno: altrimenti sarei già all'ottimo. Inoltre, avendo un metodo per scegliere sempre lo spigolo di crescita maggiore potrei dire 2 cose: l'algoritmo tende all'ottimo (il vertice da cui non si staccano spigoli che accrescono la funzione obiettivo), e termina in un numero finito di passi (prima o poi raggiungerà inevitabilmente un vertice che massimizza la funzione).

Prima però dobbiamo chiarire una questione: scegliere un nuovo spigolo significa trovare 2 indici base, uno da eliminare e uno da inserire. Si può dire che il primo indice, quello uscente, indica anche la direzione di spostamento: allentando un vincolo ci spostiamo sulla semiretta del prossimo. Allo stesso tempo, scegliere un indice da rimuovere non basta: dobbiamo scegliere quale introdurre, che geometricamente significa capire *quanto* ci possiamo spostare lungo la semiretta prima di uscire dalla regione di ammissibilità. Vediamo quindi questi due passaggi in ordine.

- **Indice uscente**

Diciamo:

$$W = \left(-A_B^{-1}\right)$$

e prendiamo le colonne W^i corrispondenti agli indici di base scelti.

Possiamo allora dire che l'equazione degli spigoli dati dalle disequazioni all'indice i sono:

$$\bar{x} + \lambda W^i$$

Mettiamo questa equazione nella funzione costo:

$$c(\bar{x} + \lambda W^i) = c\bar{x} + \lambda cW^i$$

Qui abbiamo $c\bar{x}$, che è il valore nel vertice, e un'altro termine scalato da λ . Ricordiamo poi che $cA_B^{-1} = \bar{y}_B$, e che $W = \left(-A_B^{-1}\right)$, ergo $cW^i = -\bar{y}_B$:

$$c\bar{x} + \lambda cW^i = c\bar{x} - \lambda \bar{y}_B$$

Vogliamo quindi "allentare" l'indice (e il corrispettivo vertice) che ci dà $\bar{y}_i < 0$, in quanto è quello che restituisce un $cW^i > 0$, e quindi un accrescimento della funzione. Definiamo allora questo indice:

Definizione 9.1: Indice uscente primale

Chiamiamo indice uscente h , da una certa soluzione della base B :

$$h := \min\{i \in B \text{ t.c. } \bar{y}_i < 0\}$$

Il min significa che in caso di più i negativi, si adotta la regola anticiclo (di Bland) di scegliere il primo. In caso di nessun i negativo, la complementare duale esiste e siamo sull'ottimo.

• **Indice entrante**

Adesso cerchiamo per quali λ lo spigolo $\bar{x} + \lambda W^h$ resta ammissibile, ergo soddisfa:

$$A_i (\bar{x} + \lambda W^h) \leq b_i, \quad i \in N$$

Questo significa effettivamente vedere qual'è il primo vincolo che "stringiamo", o che incontriamo, spostandoci lungo la semiretta ottenuta allentando il vincolo dato dall'indice uscente.

Possiamo dire:

$$A_i (\bar{x} + \lambda W^h) = A_i \bar{x} + \lambda A_i W^h \leq b_i$$

da cui si ricava (e si risolve) la disequazione di primo grado:

$$\lambda A_i W^h \leq b_i - A_i \bar{x} \Rightarrow \lambda \leq \frac{b_i - A_i \bar{x}}{A_i W^h}$$

Notiamo che se fosse $A_i W^h \leq 0, \forall i \in N$, avremmo che l'indice rappresenta una direzione di regressione, in quanto $\lambda \rightarrow +\infty$. Si ha quindi che il duale non ha soluzione, e il primale $\rightarrow +\infty$. In caso contrario, noi vogliamo trovare il primo vincolo che si va a stringere, quindi dovremo calcolare tutti gli r_i :

$$r_i = \frac{b_i - A_i \bar{x}}{A_i W^h}, \quad i \in N, \quad A_i W^h > 0$$

e scegliere l'indice che dà $\vartheta = \min(r_i)$. Definiamo allora anche questo indice:

Definizione 9.2: Indice entrante primale

Chiamiamo indice entrante k , da una certa soluzione della base B e un certo indice uscente h :

$$k := \min\{i \in N \text{ t.c. } A_i W^h > 0, \quad \frac{b_i - A_i \bar{x}}{A_i W^h} = \vartheta\}$$

Anche qui, il min serve a selezionare il primo indice valido, ed è una regola anticiclo (di Bland). Notiamo due possibili situazioni:

- Si potrebbero avere più r_i uguali: questi rappresentano soluzioni di base degenerate *in arrivo*, in quanto sono più modi di arrivare allo stesso vertice stringendo vincoli diversi;
- Si potrebbe avere un r_i nullo: questo significa che il vertice è sullo stesso vertice da dove siamo partiti, ergo rappresenta una soluzione di base degenera *in partenza*.

Come prima, le regole anticiclo di Bland assicurano anche che l'algoritmo non si blocchi a ciclare su queste soluzioni degeneri.

Abbiamo quindi tutti gli strumenti necessari alla formulazione dell'algoritmo del simplesso:

Algoritmo 1 del simplesso primale

Input: un problema LP in forma primale standard

Output: la soluzione ottima

Trova una base B che genera una soluzione di base primale ammissibile.

ciclo:

Calcola la soluzione di base primale $\bar{x} = A_B^{-1}b_B$ e la soluzione di base duale $\bar{y} = (cA_B^{-1}, 0)$

if $\bar{y}_B \geq 0$ **then**

Fermati, \bar{x} è ottima per P e \bar{y} è ottima per D

else

Calcola l'indice uscente:

$$h := \min\{i \in B \text{ t.c. } \bar{y}_i < 0\}$$

poni $W := -A_B^{-1}$ e indica con W^h la h -esima colonna di W

end if

if $A_i W^h \leq 0 \quad \forall i \in N$ **then**

Fermati, $P \rightarrow +\infty$ e D non ha soluzione ottima.

else

Calcola:

$$\vartheta = \min\left\{\frac{b_i - A_i \bar{x}}{A_i W^h} \text{ t.c. } i \in N, \quad A_i W^h > 0\right\}$$

e trova l'indice entrante:

$$k := \min\left\{i \in N \text{ t.c. } A_i W^h > 0, \quad \frac{b_i - A_i \bar{x}}{A_i W^h} = \vartheta\right\}$$

end if

Aggiorna la base come:

$$B := B \setminus \{h\} \cup \{k\}$$

Torna a ciclo

10 Lezione del 08-10-24

Abbiamo trovato un'algoritmo per ricavare una soluzione ottimale partendo da una soluzione di base primale ammissibile. Nel fare ciò, si è dato per scontato che l'algoritmo di partenza ci avrebbe fornito una soluzione di base primale ammissibile, e che qualsiasi successivo passo del simplesso ci avrebbe restituito altre soluzioni di base primale ammissibili. In verità, le soluzioni di base trovate possono avere le seguenti combinazioni di ammissibilità su P primale e D duale:

- **Ammissibile su P e D :** in questo caso siamo all'ottimo dalla dualità forte;
- **Ammissibile su P ma non su D :** in questo caso siamo su un comune punto ammissibile non ottimo;
- **Non ammissibile su P o D :** in questo caso si scarta la soluzione;

- **Ammissibile su D ma non su P :** effettivamente, ancora non abbiamo un modo per gestire questa situazione.

Per questo motivo estendiamo l'algoritmo del simplesso al duale.

10.1 Algoritmo del simplesso duale

Intendiamo mantenere, ad ogni passo, la soluzione di base duale come ammissibile e controllare l'ammissibilità di quella primale. Se la soluzione di base primale è ammissibile (l'inverso di come avevamo visto per il simplesso primale), allora siamo sull'ottimo. Altrimenti, si cambia base, cercando di minimizzare la funzione obiettivo su una nuova soluzione di base duale.

Abbiamo quindi un vertice del poliedro duale, cioè una soluzione di base ammissibile del duale. Ci chiediamo se questo vertice \bar{y} è ottimo. Visto che è vertice del duale, abbiamo che per una matrice A_B e un vettore costo c del primale:

$$\bar{y} = (cA_B^{-1}, 0), \quad \text{con } cA_B^{-1} \geq 0$$

dove ricordiamo questa notazione significa impostare le variabili non di base $\in N$ a 0 e risolvere il sistema in m variabili rimasto.

Adesso possiamo costruire il complementare primale \bar{x} , ponendo:

$$\bar{x} = A_B^{-1}b_B$$

e applicare il test di ammissibilità, cioè vedere se:

$$A_N(A_B^{-1}b_B) \leq b_N$$

ergo $\bar{x} \in P$, quindi il complementare duale esiste e il vertice è ottimo. Come prima, se questa condizione risulta verificata possiamo fermarci, in quanto abbiamo trovato la soluzione ottimale.

In caso contrario, avremo $\exists i \in N$ tale che $b_i - A_i(A_B^{-1}b_B) < 0$. Questo equivale a ciò che avevamo trovato per il primale per quanto riguardava gli indici uscenti, con una sola differenza: per risolvere il duale, si trova **prima l'indice entrante**, e poi l'**indice uscente**. Vediamo quindi i passaggi in ordine:

- **Indice entrante**

Abbiamo che, se il vertice non è ottimo, vale:

$$\exists i \in N \text{ t.c. } b_i - A_i(A_B^{-1}b_B) < 0$$

Vogliamo che l'indice entrante sia quell che raggiunge questo valore negativo, quindi:

Definizione 10.1: Indice entrante duale

Chiamiamo indice entrante k , da una certa soluzione della base B :

$$k := \min\{i \in N \text{ t.c. } b_i - A_i\bar{x} < 0\}$$

Come sempre, \min significa che in caso di più i negativi, si adotta la regola anticiclo (di Bland) di scegliere il primo. In caso di nessun i negativo, la complementare duale esiste e siamo sull'ottimo.

- **Indice uscente**

Cerchiamo quindi l'indice uscente. Dovremo prima definire la matrice W come $W = -A_B^{-1}$, e calcolare il prodotto (perlopiù analogo al primale, ma si noti il segno della disuguaglianza capovolto):

$$A_k W^i < 0$$

Questo ci fornisce una regola, come nel simplesso primale, per l'esistenza di una soluzione: nel caso non sia verificato, si ha che il duale $\rightarrow -\infty$ e che il primale è vuoto. In caso contrario, si possono calcolare i rapporti, come:

$$r_i = \frac{-\bar{y}_i}{A_k W^i}, \quad i \in B, A_k W^i < 0$$

e scegliere l'indice che da $\vartheta = \min r_i$, cioè:

Definizione 10.2: Indice uscente duale

Chiamiamo indice uscente h , da una certa soluzione della base B e un certo indice entrante k :

$$h := \min\{i \in B \text{ t.c. } A_k W^i < 0, \quad \frac{-\bar{y}_i}{A_k W^i} = \vartheta\}$$

Anche qui, il min serve a selezionare il primo indice valido, ed è una regola anticiclo.

Abbiamo quindi revisionato tutti gli strumenti necessari alla formulazione dell'algoritmo del simplesso, stavolta duale:

Algoritmo 2 del simplesso duale

Input: un problema LP in forma primale standard

Output: la soluzione ottima

Trova una base B che genera una soluzione di base duale ammissibile.

ciclo:

Calcola la soluzione di base duale $\bar{y} = (cA_B^{-1}, 0)$ e la soluzione di base primale $\bar{x} = A_B^{-1}b_B$

if $A_N(A_B^{-1}b_B) \leq b_N$ **then**

Fermati, \bar{y} è ottima per D e \bar{x} è ottima per P

else

Calcola l'indice entrante:

$$k := \min\{i \in N \text{ t.c. } b_i - A_i\bar{x} < 0\}$$

poni $W := -A_B^{-1}$ e indica con W^i la i -esima colonna di W

end if

if $A_k W^i \geq 0 \quad \forall i \in B$ **then**

Fermati, $D \rightarrow -\infty$ e P non ha soluzione ottima.

else

Calcola:

$$\vartheta = \min\left\{\frac{-\bar{y}_i}{A_k W^i} \text{ t.c. } i \in B, \quad A_k W^i < 0\right\}$$

e trova l'indice uscente:

$$h := \min\{i \in B \text{ t.c. } A_k W^i < 0, \quad \frac{-\bar{y}_i}{A_k W^i} = \vartheta\}$$

end if

Aggiorna la base come:

$$B := B \setminus \{h\} \cup \{k\}$$

Torna a ciclo

11 Lezione del 09-10-24

11.1 Problema duale ausiliario

Fino ad ora abbiamo rimandato la trattazione dell'algoritmo per determinare se un poliedro è vuoto. Diamo adesso quest'algoritmo, notando inoltre che, nel caso il poliedro non fosse vuoto, dovrebbe fornirci un possibile vertice di partenza per l'algoritmo del simplesso.

Partiamo da un poliedro in forma duale standard:

$$\begin{cases} Ax = b \\ x \geq 0 \end{cases}$$

dove m è il numero di variabili e n il numero di vincoli, e quindi $A : m \times n$.

Adottiamo questa forma in quanto siamo sicuri (a differenza della forma primale) che non presenti linealità. Costruiamo quindi quello che viene chiamato **duale ausilia-**

rio, DA:

$$\begin{cases} Ax = b \\ x \geq 0 \end{cases} \rightarrow \begin{cases} \min \sum_{i=1}^n \varepsilon_i \\ Ax + I\varepsilon = b \\ x_i \varepsilon \geq 0 \end{cases}$$

dove ε rappresenta un vettore di variabili ausiliarie di dimensione n , cioè una per ogni equazione. Possiamo rappresentare il sistema ottenuto anche attraverso due matrici a blocchi:

$$(A|I) \begin{pmatrix} x \\ \varepsilon \end{pmatrix}$$

Chiamiamo quindi $v(\text{DA})$ la soluzione del duale ausiliario, e formuliamo il teorema:

Teorema 11.1:

Se $v(\text{DA}) > 0$, allora $D = \emptyset$, altrimenti, se $v(\text{DA}) = 0$, $D \neq \emptyset$. Equivale a dire:

$$v(\text{DA}) = 0 \Leftrightarrow D \neq \emptyset$$

Dobbiamo però capire come risolvere il duale ausiliario, magari senza usare questo teorema, in quanto questo si andrebbe a creare una catena infinita di duali ausiliari da risolvere... Notiamo quindi che il duale ausiliario ha sempre una base plausibile, che è quella data dagli indici delle ultime n variabili, quelle introdotte come ε_i .

Non solo, abbiamo anche che:

Teorema 11.2:

La soluzione ottima di (DA) , se $D \neq \emptyset$, ci fornisce un vertice di D stesso.

Notiamo che, visto che il primo teorema chiedeva $v(\text{DA}) = 0$ perché $D \neq \emptyset$, allora si ha che nella soluzione ottima di DA nulla (quella che dimostra la non vuotezza del poliedro), le variabili ε_i sono nulle.

Il procedimento sarà quindi:

1. Prendere il problema duale;
2. Ricavare il duale ausiliario inserendo nei vincoli il vettore di n variabili ausiliarie ε ;
3. Risolvere il duale ausiliario attraverso il simplesso duale, prendendo come passo iniziale la base data dagli ultimi n indici, cioè che comprende le variabili ausiliarie appena introdotte;
4. Fare $\geq n$ passi al simplesso, aspettandoci che i primi n passi rimuovano tutte le variabili ausiliarie.

Il vertice che ricaviamo dall'algoritmo prende il nome di **soluzione ammissibile di base**.

11.2 Ricavare le variazioni dai cambi di base

Abbiamo che svolgere un passo al simplesso (primale o duale) significa effettuare un cambio di base, con base entrante e base uscente. Possiamo calcolare valori definiti, che

la soluzione di base sia ammissibile o meno, per la funzione obiettivo del primale e del duale per qualsiasi base.

Potremmo voler calcolare qual'è la variazione di valore di questa funzione dato un certo cambio di base. Ricordiamo quindi di aver introdotto la formula per spostarci lungo i vincoli di un certo λ sul primale:

$$cx(\lambda) = c\bar{x} - \lambda\bar{y}_h$$

e sul duale:

$$by(\lambda) = b\bar{y} + \lambda(b_h - A_k\bar{x})$$

Queste due formule stabiliscono un legame fra il valore della funzione obiettivo e quello di determinate soluzioni \bar{x} e \bar{y} sottoposte a perturbazioni nella direzione dei vertici entranti (cioè allentando il vincolo h) di valore λ . Possiamo quindi usarle per calcolare quanto di chiedevamo all'inizio del paragrafo: la variazione del valore delle funzioni obiettivo del primale e del duale dopo il cambio di base, ricordando che il nostro λ sarà il rapporto r_i (in particolare lo avevamo chiamato ϑ) scelto per determinare il vincolo entrante (primale) o uscente (duale):

$$r_p = \frac{b_k - A_k\bar{x}}{A_k W^h}, \quad r_d = \frac{-\bar{y}_h}{A_k W^h}$$

11.3 Riassunto sulle regole anticiclo

Abbiamo introdotto, nel corso della trattazione degli algoritmi del semplice, le **regole anticiclo di Bland**. Possiamo riassumerle come segue:

- **Simpleso primale**

- **Regola anticiclo per l'indice uscente:** quando si calcola l'indice uscente h del simpleso primale, si considera una certa soluzione di base complementare duale $\bar{y} = (cA_b^{-1}1, 0)$. Se consideriamo ogni componente di \bar{y} come il "prezzo ombra" associato ad ogni vincolo, cioè il guadagno (in verità l'opposto del guadagno) che potremmo avere rilassando quel vincolo, sembrerebbe conveniente prendere l'indice del componente più negativo come indice uscente. In verità, su certi problemi con soluzioni degeneri questo potrebbe causare cicli infiniti sulle basi degeneri. Per questo si adotta la regola anticiclo di prendere il primo indice negativo. Così si evitano cicli anche su basi degeneri, cioè ci si assicura che l'algoritmo termina in un numero finito di passi:

$$h := \min\{i \in B \text{ t.c. } \bar{y}_i < 0\}$$

- **Regola anticiclo per l'indice entrante:** allo stesso modo, quando si calcola l'indice entrante k del simpleso primale, si considerano i rapporti, che rappresentano le distanze sulla base definita dagli indici di base scelti degli altri vincoli, per scegliere il prossimo vincolo più vicino:

$$r_i = \frac{b_i - A_i\bar{x}}{A_i W^h}, \quad \min(r_i) = \vartheta$$

Si potrebbe avere che più indici hanno rapporto che corrisponde a ϑ . Anche in questo caso è necessario scegliere sempre l'indice più piccolo, in quanto questi rappresentano basi degeneri, ovvero un punto che resta vertice su diverse basi, e senza un'apposita regola si potrebbe finire per ciclare:

$$k := \min\{i \in N \text{ t.c. } A_i W^h > 0, \quad \frac{b_i - A_i\bar{x}}{A_i W^h} = \vartheta\}$$

• **Simplesso duale**

- **Regola anticiclo per l'indice duale:** nel simplesso duale, prima si calcola l'indice entrante k considerando la soluzione di base primale, ovvero prendendo gli i tali che $b_i - A_i \bar{x} < 0$. Potrebbero esistere più i che rispettano la proprietà, e bisogna quindi prendere l'indice i più piccolo:

$$k := \min\{i \in N \text{ t.c. } b_i - A_i \bar{x} < 0\}$$

- **Regola anticiclo per l'indice entrante:** infine, nel simplesso duale, si calcola l'indice uscente h prendendo i rapporti, analoghi a quelli del simplesso primale:

$$r_i = \frac{\bar{y}_i}{A_k W^i}, \quad \min(r_i) = \vartheta$$

anche qui si potrebbero avere più rapporti "distanza" con rapporto ϑ . Di questi va nuovamente preso quello con l'indice minore:

$$h := \min\{i \in B \text{ t.c. } A_k W^i < 0, \quad \frac{-\bar{y}_i}{A_k W^i} = \vartheta\}$$

In generale, si può dire che in condizioni di sicurezza di non esistenza di basi degeneri, queste regole potrebbero non essere applicate. In tutti gli altri casi, evitano eventuali cicli sulle stesse basi degeneri.

11.4 Casi degeneri

Concludiamo infine la trattazione della PL notando il motivo dell'uso delle regole anticiclo di Bland nel calcolo degli indici uscenti ed entranti nell'algoritmo del simplesso. Prendiamo un problema di esempio:

$$\begin{cases} \max(x_1 + x_2) \\ x_1 \leq 1 \\ x_2 \leq 1 \\ x_1 + x_2 \leq 2 \\ x_i \geq 0 \end{cases}$$

Si ha che il vertice del poliedro $\bar{x} = (1, 1)$ è degenero: possiamo ottenerlo dalle basi $B = \{1, 2\}$, $B = \{1, 3\}$ e $B = \{2, 3\}$. In questo caso tutto funziona perché il vertice è anche ottimo, in caso contrario potremmo, se non si usassero le regole anticiclo di Bland, finire in un ciclo infinito.

Regole alternative a quella di Bland sono la scelta dell'indice sempre maggiore, o degli scarti o rapporti (apparentemente) ottimi, cioè più piccoli:

$$b_k - A_k \bar{x} = \min_{i \in N} (b_i - A_i \bar{x})$$

Queste regole, soprattutto l'ultima, potrebbero sembrare equivalenti o migliori di quelle di Bland. Invece è importante ricordare che potrebbero causare cicli.

12 Lezione del 10-10-24

12.1 Introduzione alla programmazione lineare intera

Iniziamo adesso a studiare un tipo di problemi che finora avevamo menzionato, ma mai risolto. Si pone il seguente:

Problema 12.1: Caricamento

Un ladro è riuscito a scassinare un'importante caveau, e ha di fronte a sé una serie di gemme preziose. Tenendo conto del peso e del tipo delle gemme, ricava una tabella col valore e il peso di ogni gemma:

Valore	2	4	7	9	13	16
Peso	6	8	9	11	15	18

Amesso che il suo zaino non possa portare più di 30 kg, quali gemme dovrà scegliere per avere il maggiore profitto possibile?

Questo problema riprende il celebre *knapsack problem*, che risulta essere NP-completo. Attraverso la **programmazione lineare intera**, possiamo ricavare soluzioni, almeno approssimate.

Si ha che qualsiasi possibilità delle 2^n configurazioni di gemme che il ladro può portare sono rappresentate da un vettore:

$$x = (x_0, \dots, x_n), \quad x_i \in \{0, 1\}$$

e che i il valore e il peso delle stesse sono vettori:

$$v = (2, 4, 7, 9, 13, 16)$$

$$p = (6, 8, 9, 11, 15, 18)$$

Possiamo quindi formulare il sistema:

$$\begin{cases} \max (2x_1 + 4x_2 + 7x_3 + 9x_4 + 13x_5 + 16x_6) \\ 6x_1 + 8x_2 + 9x_3 + 11x_4 + 15x_5 + 18x_6 \leq 30 \\ x \in \{0, 1\}^n \end{cases} \rightarrow \begin{cases} \max (v^T x) \\ p^T x \leq P \\ x \in \{0, 1\}^n \end{cases}$$

dove P è il vincolo di massimo dei pesi.

Questo problema ricalca la struttura di un problema LP, ma il vincolo finale, che limita i valori possibili delle componenti del vettore soluzione, lo rende IPL. Decidiamo di trasformare il problema in un LP corrispondente, che chiameremo **rilassamento continuo**, e risolvere quello.

Definizione 12.1: Rilassato continuo

Dato un problema ILP in forma:

$$\begin{cases} \max c^T \cdot x \\ Ax \leq b \\ x \in \mathbb{Z}^n \end{cases}$$

chiamiamo **rilassato continuo** il problema LP che rimuove il vincolo di interezza:

$$\begin{cases} \max c^T \cdot x \\ Ax \leq b \end{cases}$$

Possiamo ricavare questo rilassato continuo in due modi: il primo prevede di rimuovere semplicemente il vincolo, magari includendo la positività, o ancor meglio l'appartenenza $x \in [0, 1]$:

$$\begin{cases} \max (v^T x) \\ p^T x \leq P \\ 0 \leq x \leq 1 \end{cases}$$

Questo metodo è sicuramente funzionante, ma preferiamo calcolare il duale, a partire dal primale con imposta la positività:

$$\begin{cases} \max (2x_1 + 4x_2 + 7x_3 + 9x_4 + 13x_5 + 16x_6) \\ 6x_1 + 8x_2 + 9x_3 + 11x_4 + 15x_5 + 18x_6 \leq 30 \\ -x_1 \leq 0 \\ -x_2 \leq 0 \\ -x_3 \leq 0 \\ -x_4 \leq 0 \\ -x_5 \leq 0 \\ -x_6 \leq 0 \end{cases} \rightarrow \begin{cases} \min (30y_1) \\ 6y_1 - y_2 = 2 \\ 8y_1 - y_3 = 4 \\ 9y_1 - y_4 = 7 \\ 11y_1 - y_5 = 9 \\ 15y_1 - y_6 = 13 \\ 18y_1 - y_7 = 16 \\ y_i \geq 0 \end{cases}$$

da cui notiamo che le disequazioni in forma $a_i x + s_i = b_i$ si possono rendere come $a_i x \geq b_i$:

$$\begin{cases} \min (30y_1) \\ 6y_1 \geq 2 \\ 8y_1 \geq 4 \\ 9y_1 \geq 7 \\ 11y_1 \geq 9 \\ 15y_1 \geq 13 \\ 18y_1 \geq 16 \\ y_1 \geq 0 \end{cases} \equiv \begin{cases} \min (30y_1) \\ y_1 \geq \frac{1}{3} \\ y_1 \geq \frac{1}{2} \\ y_1 \geq \frac{7}{9} \\ y_1 \geq \frac{9}{11} \\ y_1 \geq \frac{13}{15} \\ y_1 \geq \frac{8}{9} \\ y_1 \geq 0 \end{cases}$$

Abbiamo che questo sistema è banale: il minimo di $30y_1$ sottoposto ai vincoli si avrà quando y_1 rispetta i vincoli, che sono tutti \geq , e rispettare qualsiasi vincolo significa rispettare il vincolo con b_i più grande, quindi in questo caso $\frac{8}{9}$. Si ha quindi che la soluzione ottima del duale è $\frac{8}{9}$, e possiamo trovare con la stessa facilità la soluzione del primale:

abbiamo che la disequazione da cui si è ricavato la soluzione del duale ha indice $j = 6$. Si prende quindi la variabile con lo stesso indice nel primale, e si **satura**, cioè si porta al livello più alto possibile prima di violare il limite. Si nota che il valore ottimo trovato nel primale e nel duale (che è uguale dalla dualità forte) è $v = P\bar{y}_j = v_j\bar{x}_j$, con \bar{x} e \bar{y} le soluzioni ottime trovate rispettivamente al primale e al duale.

Nel nostro caso, $18x_6 \leq 30$, quindi $x_6 = \frac{30}{18}$, con valore $v = 16\frac{30}{18} = \frac{80}{3}$.

Questo approccio sarebbe quello che si applicherebbe intuitivamente senza sapere nulla di PL. Infatti i rapporti calcolati nel duale:

$$r_i = \frac{v_i}{p_i}$$

sono effettivamente i **rendimenti** di ogni elemento di peso e valore, cioè quanto valore portano in rapporto al loro peso. Chiaramente, vorremmo massimizzare gli elementi con rendimento maggiore, quindi saturiamo gli elementi con r_i massimo. Possiamo quindi definire il seguente algoritmo:

Algoritmo 3 caricamento per soluzioni ottime del rilassato continuo

Input: il rilassato continuo di un problema di caricamento

Output: la soluzione ottima \bar{x}

Considera i $r_i = \frac{v_i}{p_i}$ rendimenti di ogni elemento

Scegli l'indice j del rendimento massimo r_j

Satura la variabile j

Abbiamo che la soluzione trovata è un limite superiore per il problema di partenza, quello ILP: infatti, rilassando i vincoli, otteniamo una regione ammissibile più grande, e quindi aumentiamo il massimo. In verità anche l'arrotondamento in basso della soluzione v è un limite superiore: nel caso del problema abbiamo $\lfloor \frac{80}{3} \rfloor = 26$.

Un'idea banale per trovare il punto ottimo di questo problema ILP potrebbe essere quello di arrotondare il punto ottimo del rilassato continuo: nel nostro esempio, troviamo $\bar{x} = (0, 0, 0, 0, 0, 1)$, che dà massimo $v = 16$.

Notiamo un risultato fondamentale: se chiamiamo il valore arrotondato della soluzione del rilassato continuo v_s , e il valore ottenuto nell'approssimazione del *punto* di ottimo v_i , è vero che:

$$v_i \leq v_{ILP} \leq v_s$$

dove v_{ILP} è la soluzione del problema ILP che stiamo cercando. Per la precisione, possiamo definire l'errore:

$$\varepsilon = \frac{v_s - v_i}{v_i}$$

che sul problema in esame dà $\varepsilon \approx 60\%$, chiaramente poco utile. Sarà necessario adottare un qualche metodo per migliorare la stima data dall'arrotondamento del punto di ottimo del rilassato continuo.

Per adesso, generalizziamo quando trovato finora: bisogna distinguere fra v_i e v_s che si parli di problemi di minimizzazione o di massimizzazione. Si ha infatti che:

Teorema 12.1: Bound di problemi ILP

Per un dato problema ILP con soluzione v_{ILP} , si ha che:

$$v_i \leq v_{PLI} \leq v_s$$

- Se il problema è di **massimizzazione**, v_i è il valore calcolato soluzione ammissibile del rilassato continuo arrotondata **per difetto**, e v_s è la soluzione ottima del rilassato continuo arrotondata **per difetto**;
- Se il problema è di **minimizzazione**, v_i è la soluzione ottima del rilassato continuo arrotondata **per eccesso**, e v_s è il valore calcolato soluzione ammissibile del rilassato continuo arrotondata **per eccesso**;

12.1.1 Vincoli booleani

Possiamo chiamare il vincolo introdotto prima, $x \in \{0, 1\}^n$, **vincolo booleano** (in modo più o meno informale). Come abbiamo detto, questo vincolo può essere reso come $x_i \geq 0$, o ancor meglio $0 \leq x_i \leq 1$ quando si porta al rilassato continuo (abbiamo usato il primo insieme di vincoli per ricavare il duale del rilassato continuo).

Introduciamo quindi l'algoritmo, equivalente a quello presentato prima per :

Algoritmo 4 caricamento per soluzioni ottime del rilassato continuo con vincolo booleano

Input: il rilassato continuo di un problema con vincolo booleano

Output: la soluzione ottima \bar{x}

Considera i $r_i = \frac{v_i}{p_i}$ rendimenti di ogni elemento

Scegli l'indice j del rendimento massimo r_j

Satura la variabile j

Quando finisci lo spazio, satura con il bene rimanente (sic.)

13 Lezione del 14-10-24**13.1 Algoritmi dei rendimenti**

Riassumiamo i quattro algoritmi presentati finora per le valutazioni inferiori e superiori di problemi di ILP (con vincolo $x \in \mathbb{Z}^n$). Prendiamo in esempio lo "zaino": con $P = 7$. Il

v	10	17	22	21
p	4	5	6	2

vettore dei rendimenti sarà quindi:

$$r = \left(\frac{10}{4}, \frac{17}{5}, \frac{22}{6}, \frac{21}{2} \right) \approx (2.5, 3.4, 3.66, 10.5)$$

- **Problema booleano**

$$\begin{cases} \max(10x_1 + 17x_2 + 22x_3 + 21x_4) \\ 4x_1 + 5x_2 + 6x_3 + 2x_4 \leq 7 \\ x \in \{0, 1\}^n \end{cases}$$

si hanno gli algoritmi di valutazione:

- **Valutazione inferiore:** si prendono le variabili con rendimenti migliori, una volta sola, finché non si satura. Nel caso la variabile esca da P , si prende quella dopo, con il caso limite di non prendere nulla. Si ha quindi:

$$x = (0, 1, 0, 1), \quad V_I = 21 + 17 = 38$$

- **Valutazione superiore:** si prende il rilassato continuo:

$$\begin{cases} \max(v^T x) \\ p^T x \leq \\ 0 \leq x \leq 1 \end{cases}$$

e si riempie con le variabili dai rendimenti migliori, saturando l'ultima:

$$x = \left(0, 0, \frac{5}{6}, 1\right), \quad V_\alpha = 21 + \frac{5}{6}22 = 39.\bar{3}, \quad V_S = \lfloor V_\alpha \rfloor = \lfloor 39.\bar{3} \rfloor = 39$$

Si ha quindi $V_I = 38$ e $V_S = 39$, con errore $\epsilon = \frac{39-38}{38} = \frac{1}{38} = 2.6\%$.

• Problema intero

$$\begin{cases} \max(10x_1 + 17x_2 + 22x_3 + 21x_4) \\ 4x_1 + 5x_2 + 6x_3 + 2x_4 \leq 7 \\ x \leq 0 \end{cases}$$

si hanno gli algoritmi di valutazione:

- **Valutazione inferiore:** si prendono le variabili con rendimenti migliori, con coefficienti maggiori possibili, finché non si satura. Nel caso la variabile esca da P , si prende quella dopo, con il caso limite di non prendere nulla. Si ha quindi:

$$x = (0, 0, 0, 3), \quad V_I = 3 \cdot 21 = 63$$

- **Valutazione superiore:** si prende il rilassato continuo:

$$\begin{cases} \max(v^T x) \\ p^T x \leq \\ 0 \leq x \end{cases}$$

e si riempie con le variabili dai rendimenti migliori, saturando dalla prima:

$$x = \left(0, 0, 0, \frac{7}{2}\right), \quad V_\alpha = \frac{7}{2}22 = 77, \quad V_S = \lfloor V_\alpha \rfloor = \lfloor 77 \rfloor = 77$$

Si ha quindi $V_I = 63$ e $V_S = 77$, con errore $\epsilon = \frac{77-63}{63} = \frac{14}{63} = \frac{2}{9} = 22.2\%$. Notiamo come sul problema intero si accumuli molto più errore.

Dobbiamo fare un'ulteriore precisazione: si prendono approssimazioni per **difetto** quanto si parla di problemi di *massimo*. Nel caso di problemi di *minimo*, è opportuno prendere approssimazioni per **eccesso**.

14 Lezione del 15-10-24

14.1 Relazioni tra LP e ILP

Vediamo di approfondire il legame fra un problema ILP e i problemi LP che possiamo ricavarne. Avevamo posto un problema ILP in forma:

$$\begin{cases} \max(c^T x) \\ Ax \leq b \\ x \in \mathbb{Z}^n \end{cases}$$

E avevamo visto che si può trovare un limite inferiore V_I e un limite superiore V_S a partire dagli algoritmi dei rendimenti, quindi prendendo il rilassato continuo del problema, cioè l'associato che rimuove il vincolo $x \in \mathbb{Z}^n$:

$$\begin{cases} \max(c^T x) \\ Ax \leq b \end{cases}$$

Chiamiamo P il poliedro del rilassato continuo. Si ha, in generale, che la soluzione di un problema di ILP è uno dei punti $\in \Omega = P \cap \mathbb{Z}^n$, cioè dei punti $\in \mathbb{Z}^n$ che stanno all'interno del poliedro del rilassato continuo. Poniamo ad esempio il problema:

$$\begin{cases} \max(0.3x_1 + 0.4x_2) \\ 3x_1 + 5x_2 \leq 15 \\ 4x_1 + 4x_2 \leq 16 \\ x_i \geq 0 \\ x \in \mathbb{Z}^2 \end{cases}$$

Graficamente, si ha:



dove si è riportata la soluzione ottima del rilassato x_{V_S} .

Notiamo quindi che esiste un'insieme:

$$\text{conv}(\Omega) = \left\{ x \in \mathbb{R}^n : \exists x_1, \dots, x_p \in \Omega, \quad \lambda_1, \dots, \lambda_p \geq 0 \quad \text{t.c.} \quad x = \sum_{i=1}^p \lambda_i x_i, \quad \sum_{i=1}^p \lambda_i = 1 \right\}$$

cioè l'involucro convesso di Ω . Visto che i punti di Ω hanno componenti intere, si può dimostrare il seguente teorema:

Teorema 14.1: Caratterizzazione della regione ammissibile di un problema ILP

Dato un problema ILP con regione ammissibile Ω , esiste un insieme finito di punti $\{q_l\}_{l \in L} = \{q_1, \dots, q_{|L|}\}$ di Ω , e un insieme finito di direzioni di recessione $\{r_j\}_{j \in J} = \{r_1, \dots, r_{|J|}\}$ di P , tali che:

$$\Omega = \left\{ x \in \mathbb{R}_+^n : x = \sum_{l \in L} \alpha_l q_l + \sum_{j \in J} \beta_j r_j, \quad \sum_{l \in L} \alpha_l = 1, \quad \alpha \in \mathbb{Z}_+^{|L|}, \quad \beta \in \mathbb{Z}_+^{|J|} \right\}$$

cioè si può ricavare Ω attraverso una forma simile alla $P = \text{conv}(V) + \text{cono}(E)$ del teorema di Minkowski-Weyl, sugli insiemi $\{q_l\}_{l \in L}$ di vertici a componenti intere e $\{r_j\}_{j \in J}$ di direzioni di recessione.

A partire da questa caratterizzazione di Ω , vogliamo caratterizzare $\text{conv}(\Omega)$:

Teorema 14.2: Caratterizzazione dell'involucro convesso della regione ammissibile di un problema ILP

Dato un problema ILP con regione ammissibile Ω , si ha che $\text{conv}(\Omega)$ è un **poliedro razionale**, cioè esistono due insiemi finiti di vettori, $\{q_l\}_{l \in L}$ e $\{r_j\}_{j \in J}$, a **componenti razionali**, tali che:

$$\text{conv}(\Omega) = \text{conv} \{q_l\}_{l \in L} + \text{cono} \{r_j\}_{j \in J}$$

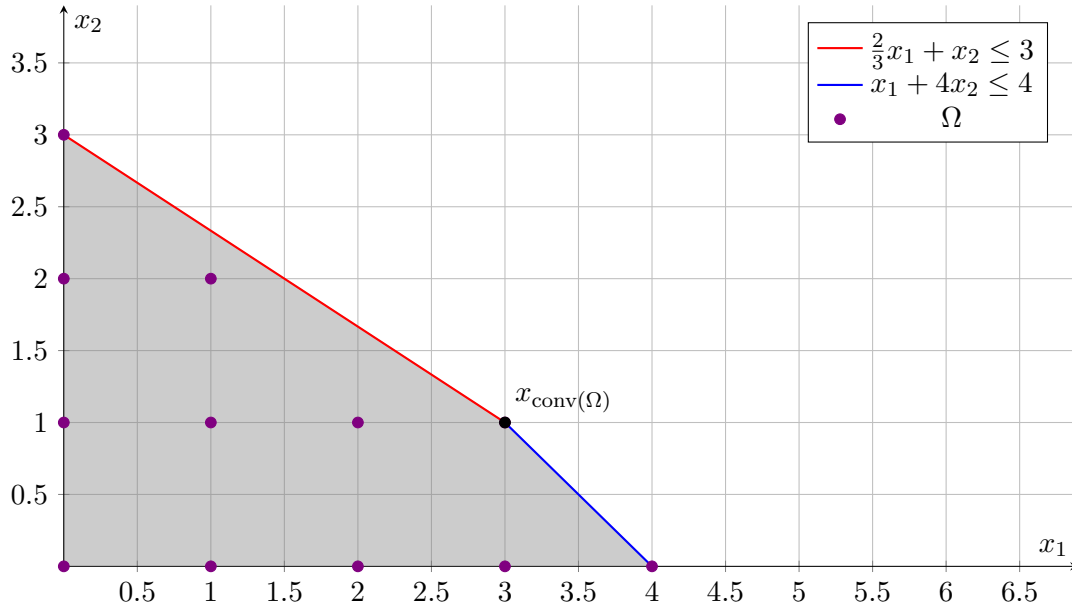
Addirittura, normalizzando si può supporre che gli r_j siano a componenti intere. Nell'esempio precedente, $\text{conv}(\Omega)$ sarebbe rappresentato dagli insiemi:

$$\{q_l\}_{l \in L} = \{(0, 0), (0, 3), (3, 1), (4, 0)\}, \quad \{r_j\}_{j \in J} = \emptyset$$

quindi:

$$\text{conv}(\Omega) = \text{conv} \{q_l\}_{l \in L} + \text{cono} \{r_j\}_{j \in J} = (x_1, x_2) \in \mathbb{R}^2 \quad \text{t.c.} \quad \begin{cases} \frac{2}{3}x_1 + x_2 \leq 3 \\ x_1 + x_2 \leq 4 \end{cases}$$

cioè sul grafico:



dove è stata evidenziata la soluzione del primale sull'insieme $\text{conv}(\Omega)$, $x_{\text{conv}(\Omega)}$.

Possiamo quindi dire, visto che $\Omega \subset \text{conv}(\Omega)$ e che P è un'estensione di Ω in quanto poliedro del rilassato continuo, che è vera la catena di disequaglianze:

$$\max_{x \in \Omega} c^T x \leq \max_{x \in \text{conv}(\Omega)} c^T x \leq \max_{x \in P} c^T x$$

e non solo: si può stringere la disequaglianza sul lato sinistro, per affermare che:

Teorema 14.3: Equivalenza fra problemi LP e ILP

Si prenda un problema di ILP, e il problema di LP associato costruito su:

$$\text{conv}(\Omega) = \text{conv} \{q_l\}_{l \in L} + \text{cono} \{r_j\}_{j \in J}$$

con, posto P come il poliedro del rilassato continuo, q ricavato dai vertici $P \cap \mathbb{Z}^n$, e r ricavato dalle direzioni di recessione di P .

Se si prendono le soluzioni:

$$v_\Omega = \max_{x \in \Omega} c^T x, \quad v_{\text{conv}(\Omega)} = \max_{x \in \text{conv}(\Omega)} c^T x$$

si ha che $v_\Omega = v_{\text{conv}(\Omega)}$, e che se $v_{\text{conv}(\Omega)}$ è finito, allora esiste $x_\Omega \in \Omega$ tale che $c^T x_\Omega = v_\Omega = v_{\text{conv}(\Omega)}$

Siamo quindi arrivati a formulare un teorema secondo cui, per ogni problema ILP, possiamo costruire un problema LP associato che ha la stessa soluzione, semplicemente riformulando i vincoli in modo che descrivano l'involucro convesso dei punti in $\Omega = P \cap \mathbb{Z}^n$, ed eventuali direzioni di recessione di P , dove P è il poliedro del rilassato continuo. Il problema sorge dal fatto che è *difficile* (nell'accezione di *difficile* data dalla complessità) ricavare questo problema associato.

14.1.1 Caratterizzazione dell'involucro convesso

Esistono tre strade principali per il calcolo di $\text{conv}(\Omega)$:

- **Matrici unimodulari:** in problemi LP dove i vincoli sono espressi da matrici particolari, che chiameremo **unimodulari**, si ha che P ha vertici a componenti intere, e quindi il $\text{conv}(\Omega) = P \cap \mathbb{Z}^n$ degli Ω a componenti interi non potrà che coincidere con P che li contiene. Questi problemi sono ad esempio quelli di flusso a costo minimo.
- **Combinatoria poliedrale:** in alcuni problemi LP espressi su grafi, si può stabilire la forma delle disequazioni che esprimono $\text{conv}(\Omega)$. Ad esempio, si ha che i problemi di accoppiamento massimo sui grafi, che richiedono di trovare il maggior numero di archi attraverso il cui si può realizzare un accoppiamento, risulta coincidente in P e $\text{conv}\Omega$ quando il grafo di interesse è **bipartito**, cioè è divisibile in due insiemi di nodi U e V tali che ogni arco porta da $U \rightarrow V$ o viceversa.
- **Piani di taglio:** quando non si possono applicare i metodi riportati sopra, l'unica strada è quella di trovare una serie di disequazioni successive che riducono l'insieme P fino al minimale $\text{conv}(\Omega)$. Uno dei metodi che andremo a vedere per realizzare queste riduzioni è quello dei **piani di taglio di Gomory**.

14.1.2 Matrici unimodulari

Definiamo innanzitutto:

Definizione 14.1: Matrice unimodulare

Si chiama **modulare** ogni matrice quadrata intera con determinante $\det A_m \in \{1, -1\}$.

e, sulla base di questo:

Definizione 14.2: Matrice totalmente unimodulare

Si chiama **totalmente unimodulare** ogni matrice per cui ogni sottomatrice quadrata invertibile è unimodulare, cioè ogni sottomatrice quadrata ha determinante $\det(A_m) \in \{0, 1, -1\}$.

Si ha che se una matrice è unimodulare, allora i vertici della regione ammissibile appartengono a \mathbb{Z}^n , infatti:

Teorema 14.4: Soluzioni di base di matrici unimodulari

Dato $Ax \leq b$, se A e b sono a componenti intere, e A è totalmente unimodulare, allora tutte le soluzioni di base del poliedro P :

$$P = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax \leq b\}$$

sono a componenti intere.

dove per componenti intere intendiamo anche razionali sotto normalizzazione.

Questo risultato è molto utile: abbiamo che le matrici A dei problemi di **trasporto** e **assegnamento di costo minimo** sono totalmente unimodulari, ergo possiamo risolvere le versioni ILP di quei problemi semplicemente rimuovendo il vincolo di interezza $x \in \mathbb{Z}^n$.

15 Lezione del 16-10-24

15.1 Problema di impacchettamento

Problema 15.1: Impacchettamento

Poniamo di avere 6 file, contenenti registrazioni di tutta la musica di Mozart, con il seguente ingombro in gigabyte:

	Arie	Opere	Concerti	Sinfonie	Sonate	Messe
p	3	6	5	4	4	8

Vogliamo trovare il numero minimo di dischi rigidi di dimensione $P = 10$ per archiviare tutti di questi file.

Chiamiamo questi problemi anche problemi di *bin-packing*. Rappresentiamo la soluzione come una matrice di adiacenza:

$$x_{ij} = \begin{cases} 0 \\ 1 \end{cases}$$

dove $i \in \{1, \dots, p\}$ rappresenta il contenitore e $j \in \{1, \dots, 6\}$ l'oggetto che vi inseriamo. Conviene trovare prima una stima superiore per il numero di contenitori p , attraverso un'opportuno algoritmo greedy.

Un'algoritmo banale può essere quello di riempire finché è possibile il primo contenitore, cioè finché si hanno oggetti che entrano nello spazio libero (detto *sfrido*) del contenitore. Una volta che questa ipotesi è violata, si prende un'altro contenitore, e così via.

Si ricava quindi questa valutazione superiore V_S . A questo punto si può porre:

$$\begin{cases} x_{11} + x_{21} + x_{31} + x_{41} = 1 \\ x_{12} + x_{22} + x_{32} + x_{42} = 1 \\ \dots \\ x_{16} + x_{26} + x_{36} + x_{46} = 1 \end{cases}$$

cioè vogliamo prendere uno e uno solo di tutti gli oggetti, disposti fra i $V_S = 4$ contenitori di valutazione superiore.

Visto che non siamo sicuri di dover prendere tutti i contenitori, dovremo introdurre una variabile y_i per ognuno di essi:

$$y_i = \begin{cases} 0 \\ 1 \end{cases}$$

Infine vogliamo inserire la dimensione di ogni contenitore, $P = 10$, nel problema, sulla base dei pesi p_i di ogni oggetto:

$$\begin{cases} p_1x_{11} + p_2x_{12} + p_3x_{13} + p_4x_{14} + p_5x_{15} + p_6x_{16} \leq 10y_1 \\ p_1x_{21} + p_2x_{22} + p_3x_{23} + p_4x_{24} + p_5x_{25} + p_6x_{26} \leq 10y_2 \\ \dots \\ p_1x_{41} + p_2x_{42} + p_3x_{43} + p_4x_{44} + p_5x_{45} + p_6x_{46} \leq 10y_4 \end{cases}$$

Combinando quanto posto finora, otteniamo il problema completo:

$$\left\{ \begin{array}{l} \min(y_1 + y_2 + y_3 + y_4) \\ x_{11} + x_{21} + x_{31} + x_{41} = 1 \\ x_{12} + x_{22} + x_{32} + x_{42} = 1 \\ \dots \\ x_{16} + x_{26} + x_{36} + x_{46} = 1 \\ p_1x_{11} + p_2x_{12} + p_3x_{13} + p_4x_{14} + p_5x_{15} + p_6x_{16} \leq 10y_1 \\ p_1x_{21} + p_2x_{22} + p_3x_{23} + p_4x_{24} + p_5x_{25} + p_6x_{26} \leq 10y_2 \\ \dots \\ p_1x_{41} + p_2x_{42} + p_3x_{43} + p_4x_{44} + p_5x_{45} + p_6x_{46} \leq 10y_4 \\ x_i \in \{0, 1\} \\ y_i \in \{0, 1\} \end{array} \right.$$

dove minimizziamo gli y_i cercando di usare meno contenitori possibile. Questo è un problema di ILP. Cerchiamo quindi la valutazione inferiore V_I e la superiore V_S .

Possiamo dare una stima inferiore attraverso la formula:

$$V_I = \left\lceil \frac{\sum_{j=1}^6 p_j}{P} \right\rceil$$

cioè il peso di tutti gli oggetti diviso le dimensioni dei contenitori, arrotondato per eccesso, che è il minimo numero di contenitori possibile per contenere tutti gli oggetti.

Per il calcolo della stima superiore, invece, avevamo presentato un algoritmo greedy. In verità sono ci altre (e più intelligenti) strade che possiamo prendere:

- **Next-fit decreasing:** essenzialmente l'algoritmo presentato, dove si ha:

Algoritmo 5 next-fit decreasing per impacchettamento

Input: un problema di impacchettamento

Output: una soluzione ammissibile

while ci sono ancora oggetti **do**

 Prendi il prossimo oggetto

if entra nel contenitore **then**

 Inseriscilo nel contenitore

else

 Prendi un'altro contenitore e inseriscici l'oggetto

end if

end while

- **First-fit decreasing:** analogo al next-fit, ma con la differenza che per ogni oggetto si considerano tutti i contenitori:

Algoritmo 6 first-fit decreasing per impacchettamento

Input: un problema di impacchettamento
Output: una soluzione ammissibile
while ci sono ancora oggetti **do**
 Prendi il prossimo oggetto
 if l'oggetto entra in uno dei contenitori presi finora **then**
 Inseriscilo nel contenitore
 else
 Prendi un'altro contenitore e inseriscici l'oggetto
 end if
end while

- **Best-fit decreasing:** è una variante del first-fit che prende sempre i contenitori con sfrido massimo, cioè cerca di riempire i contenitori con meno spazio disponibile (cioè di trovare l'"incastro" migliore per l'oggetto):

Algoritmo 7 best-fit decreasing per impacchettamento

Input: un problema di impacchettamento
Output: una soluzione ammissibile
while ci sono ancora oggetti **do**
 Prendi il prossimo oggetto
 if l'oggetto entra in uno dei contenitori, ordinati per sfrido decrescente, presi finora **then**
 Inseriscilo nel contenitore
 else
 Prendi un'altro contenitore e inseriscici l'oggetto
 end if
end while

16 Lezione del 17-10-24

16.1 Piani di taglio

Abbiamo visto finora il problema:

$$\begin{cases} \max c^T x \\ Ax \leq b, x \in \mathbb{Z}_+^n \end{cases}$$

Dove si può definire il poliedro P del rilassato continuo:

$$P = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax \leq b\} \rightarrow s_{PL}, x_{RC}$$

L'insieme dei punti Ω :

$$\Omega = \{x \in \mathbb{Z}^n : Ax \leq b\} \rightarrow v_{PLI}, \bar{x}$$

E un problema di PL associato, "ristretto" sul convesso dell'insieme Ω , di cui però non sapevamo caratterizzare le disequazioni (salvo alcuni casi specifici in problemi di PL sui grafi):

$$\text{conv}(\Omega) \rightarrow v_{\text{conv}(\Omega)}, \bar{x}$$

Sappiamo valere, fra queste soluzioni, la catena di disuguaglianze:

$$v_{PLI} = v_{\text{conv}(\Omega)} \leq v_{PL}$$

Decidiamo di ridurre le dimensioni dell'insieme P , visto che $\text{conv}(\Omega) \subseteq P$, per approssimare $\text{conv}(\Omega)$ stesso. Facciamo ciò sfruttando le cosiddette **disuguaglianze valide** (DV):

Definizione 16.1: Disuguaglianza valida

Una disuguaglianza è una DV di un'insieme $\Omega \subset \mathbb{Z}^n$ se rispetta la forma:

$$\gamma^T x \leq \gamma_0, \quad \forall x \in \Omega$$

Abbiamo quindi che una disuguaglianza è valida se contiene Ω completamente nel semispazio che definisce. Si può poi dimostrare il fatto piuttosto ovvio:

Teorema 16.1: Disuguaglianza valida dell'involucro convesso

una disuguaglianza valida per un'insieme Ω lo è anche per $\text{conv}(\Omega)$.

Una tecnica di base per il calcolo delle disuguaglianze valide è quella dell'approssimazione per difetto delle disuguaglianze che definiscono P . Questo però è poco utile nel caso di problemi già definiti con disuguaglianze in componenti intere. Introduciamo quindi l'idea di un **piano di taglio**:

Definizione 16.2: Piano di taglio

Su un problema di PLI con soluzione x_{RC} al rilassato continuo, una DV in forma:

$$\gamma x \leq \gamma_0, \quad \forall x \in S : \gamma x_{RC} > \gamma_0$$

si dice **piano di taglio**.

L'idea dei piani di taglio è quella di rimuovere successivamente soluzioni di P fuori da $\text{conv}(\Omega)$. Supponiamo di avere il problema:

$$\begin{cases} \max c^T x \\ Ax \leq b \\ \gamma x \leq \gamma_0 \end{cases} \rightarrow V_{P_n}$$

Vogliamo ricavare un poliedro P_n , che contiene l'ottimo v_{PLI} , ma che è più piccolo del rilassato continuo:

$$v_{PLI} \leq v_{P_n} \leq v_{PL}$$

Per fare ciò, prendiamo una DV che non contiene x_{RC} soluzione del rilassato continuo. A questo punto si avrà che, se il problema di v_{P_n} ha soluzione a componenti intere, allora coinciderà con $v_{\text{conv}(\Omega)}$, altrimenti si dovranno ripetere i passi precedenti.

Abbiamo quindi che qualsiasi problema trovato iterativamente coi piani di taglio è una riduzione della regione ammissibile. Il sottoinsieme dei piani di taglio che studieremo è quello dei **piani di taglio di Gomory**.

16.1.1 Costruzione dei piani di taglio di Gomory

Prendiamo un problema di ILP in forma:

$$\begin{cases} \max c^T x \\ Ax = b \\ x \geq 0 \\ x \in \mathbb{Z}^n \end{cases}$$

cioè in una forma simile al duale standard. Possiamo convertire qualsiasi problema in questa forma introducendo eventuali variabili di surplus per portare le disequazioni in equazioni. Ad esempio, sul problema presentato un paio di lezioni fa:

$$\begin{cases} \max(0.3x_1 + 0.4x_2) \\ 3x_1 + 5x_2 \leq 15 \\ 4x_1 + 4x_2 \leq 16 \\ x_i \geq 0 \\ x \in \mathbb{Z}^2 \end{cases}$$

si ricava:

$$\begin{cases} \max(0.3x_1 + 0.4x_2) \\ 3x_1 + 5x_2 + x_3 = 15 \\ 4x_1 + 4x_2 + x_4 = 16 \\ x_i \geq 0 \\ x \in \mathbb{Z}^2 \end{cases}$$

Dalla soluzione del rilassato continuo x_{RC} , abbiamo una base ottima B , tale per cui si può porre:

$$A = (A_B \ A_N), \quad x_{RC} = \begin{pmatrix} x_B \\ x_N \end{pmatrix}$$

cioè, A_B sono le colonne di matrice corrispondenti alla base e A_N le altre, e x_B sono le variabili di base e x_N le altre.

Definiamo allora la matrice \tilde{A} :

$$\tilde{A} = A_B^{-1} A_N$$

Prendiamo quindi un indice $r \in B$, tale che x_{RC} a r ha una componente non intera. Possiamo a questo punto enunciare il teorema:

Teorema 16.2: Teorema di Gomory

Si ha che:

$$\sum_{j \in N} \{\tilde{a}_{rj}\} x_j \geq \{(x_B)_r\}$$

è un piano di taglio.

Occorre fare qualche chiarimento sulla notazione: le graffe rappresentano l'operatore componente frazionaria, mentre l' r a pedice di x_B indica di prendere la componente all'indice r , cioè quella non intera.

Applichiamo quindi questo metodo al problema di prima. Avremo che:

$$A = \begin{pmatrix} 3 & 5 & 1 & 0 \\ 4 & 4 & 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad b = \begin{pmatrix} 15 \\ 16 \end{pmatrix}$$

e la soluzione ottima $x_{RC} = \left(\frac{5}{2}, \frac{3}{2}\right)$ sulla base ottima $B = \{1, 2\}$. Abbiamo quindi che:

$$A_B = \begin{pmatrix} 3 & 5 \\ 4 & 4 \end{pmatrix}, \quad A_N = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad x_B = \begin{pmatrix} \frac{5}{2} & \frac{3}{2} \end{pmatrix}, \quad x_N = (0, 0)$$

e la matrice \tilde{A} è:

$$\tilde{A} = A_B^{-1} A_N = A_B^{-1} = \begin{pmatrix} -\frac{1}{2} & \frac{5}{8} \\ \frac{1}{2} & -\frac{3}{8} \end{pmatrix}$$

Notiamo che in x_B entrambi i componenti sono non interi, ergo possiamo prendere i due casi:

- $r = 1$, si ha $\left\{-\frac{1}{2}\right\} x_3 + \left\{\frac{5}{8}\right\} x_4 \geq \left\{\frac{5}{2}\right\}$. Applicando l'operatore parte frazionaria, e sostituendo a x_3 e x_4 le loro espressioni in funzione di x_1 e x_2 (ricavate dalle equazioni del poliedro) si ha:

$$4x_1 + 5x_2 \leq 17$$

- $r = 2$, si ha con calcoli simili, lo stesso taglio:

$$4x_1 + 5x_2 \leq 17$$

Quindi entrambe le componenti danno lo stesso taglio (si noti che questa non è la norma). Possiamo visualizzare sul grafico cosa significa il taglio introdotto:



Notiamo che il taglio, se non ha ridotto completamente il poliedro a $\text{conv}(\Omega)$, ha portato la soluzione ottima a quella di $\text{conv}(\Omega)$.

17 Lezione del 21-10-24

17.1 Applicazione dell'algoritmo di riduzione del gap

Applichiamo il metodo dei piani di taglio di Gomory ad alcuni problemi di ILP.

17.1.1 Zaino intero

Prendiamo il problema:

$$\begin{cases} \max 30x_1 + 36x_2 + 27x_3 + 20x_4 + 24x_5 + 22x_6 \\ 13x_1 + 16x_2 + 14x_3 + 15x_4 + 17x_5 + 14x_6 \leq 57 \\ x \in \mathbb{Z}_+ \end{cases}$$

con il vettore dei rendimenti:

$$r = (2.3, 2.25, 1.93, 1.33, 1.41, 1.57)$$

Saturiamo per ottenere una soluzione x_{RC} , e quindi una valutazione superiore:

$$x_{RC} = \left(\frac{57}{13}, 0, 0, 0, 0, 0 \right), \quad v_S = 131$$

e saturiamo l'intero per avere una valutazione inferiore:

$$x_I = (4, 0, 0, 0, 0, 0), \quad v_I = 120$$

Adesso applichiamo Gomory:

1. Si porta il rilassato continuo in formato duale standard:

$$\begin{cases} \max 30x_1 + 36x_2 + 27x_3 + 20x_4 + 24x_5 + 22x_6 \\ 13x_1 + 16x_2 + 14x_3 + 15x_4 + 17x_5 + 14x_6 + x_7 = 57 \\ x_i \geq 0 \end{cases}$$

2. Si individua la base ottima:

$$x_{RC} = \left(\frac{57}{13}, 0, 0, 0, 0, 0 \right) \Rightarrow B = \{1\}$$

3. Si ricavano A_B , A_N , x_B , x_N e r :

$$A_B = (13), \quad A_N = (16 \ 14 \ 15 \ 17 \ 14 \ 1), \quad x_B = \left(\frac{57}{13} \right), \quad x_N = (0, 0, 0, 0, 0)$$

e chiaramente $r = 1$;

4. Si ricava \tilde{A} :

$$\tilde{A} = A_B^{-1} A_N = \left(\frac{16}{13}, \frac{14}{13}, \frac{15}{13}, \frac{17}{13}, \frac{14}{13}, \frac{1}{13} \right)$$

5. Si trova il nuovo vincolo:

$$\left\{\frac{16}{13}\right\}x_2 + \left\{\frac{14}{13}\right\}x_3 + \left\{\frac{15}{13}\right\}x_4 + \left\{\frac{17}{13}\right\}x_5 + \left\{\frac{14}{13}\right\}x_6 + \left\{\frac{1}{13}\right\}x_7 \geq \left\{\frac{57}{13}\right\}$$

$$\frac{3}{13}x_2 + \frac{1}{13}x_3 + \frac{2}{13}x_4 + \frac{4}{13}x_5 + \frac{1}{13}x_6 + \frac{1}{13}x_7 \geq \frac{5}{13}$$

Che espresso sostituendo $x_7 = 57 - 13x_1 - 16x_2 - 14x_3 - 15x_4 - 17x_5 - 14x_6$ e unito a quanto già trovato dà il problema:

$$\begin{cases} \max 30x_1 + 36x_2 + 27x_3 + 20x_4 + 24x_5 + 22x_6 \\ 13x_1 + 16x_2 + 14x_3 + 15x_4 + 17x_5 + 14x_6 \leq 57 \\ x_1 + x_2 + x_3 + x_4 + x_5 + x_6 \leq 4 \\ x \in \mathbb{Z}_+ \end{cases}$$

da cui $x_{RC} = \left(\frac{7}{3}, \frac{5}{3}, 0, 0, 0, 0\right)$, che è già più vicino all'ottimo $\bar{x} = (3, 1, 0, 0, 0, 0)$.

17.1.2 Zaino booleano

Prendiamo a questo punto:

$$\begin{cases} \max 30x_1 + 36x_2 + 27x_3 + 20x_4 + 24x_5 + 22x_6 \\ 13x_1 + 16x_2 + 14x_3 + 15x_4 + 17x_5 + 15x_6 \leq 57 \\ x \in \mathbb{Z}_+ \\ 0 \leq x \leq 1 \end{cases}$$

Attraverso la saturazione, troviamo:

$$x_{RC} = \left(1, 1, 1, 0, 0, \frac{14}{15}, 0\right), \quad v_S = 115.4$$

di valutazione superiore, e

$$x_I = (1, 1, 1, 0, 0, 0), \quad v_I = 93$$

di valutazione inferiore.

Riappliciamo Gomory.

1. L'ottimo è noto:

$$x_{RC} = \left(1, 1, 1, 0, 0, \frac{14}{15}, 0\right)$$

2. Convertiamo in formato duale standard, ricordando i vincoli $0 \leq x_i \leq 1$:

$$\begin{cases} \max 30x_1 + 36x_2 + 27x_3 + 20x_4 + 24x_5 + 22x_6 \\ 13x_1 + 16x_2 + 14x_3 + 15x_4 + 17x_5 + 15x_6 + x_7 = 57 \\ x_1 + x_8 = 1 \\ x_2 + x_9 = 1 \\ x_3 + x_{10} = 1 \\ x_4 + x_{11} = 1 \\ x_5 + x_{12} = 1 \\ x_6 + x_{13} = 1 \\ x \geq 0 \end{cases}$$

Dobbiamo ricalcolare l'ottimo:

$$x'_{RC} = \left(1, 1, 1, 0, 0, \frac{14}{15}, 0, 0, 0, 0, 1, 1, \frac{1}{15}\right)$$

3. Si individua la base ottima:

$$x'_{RC} = \left(1, 1, 1, 0, 0, \frac{14}{15}, 0, 0, 0, 0, 1, 1, \frac{1}{15}\right) \Rightarrow B = \{1, 2, 3, 6, 11, 12, 13\}$$

4. Si ricavano A_B, A_N, x_B, x_N e r . Conviene prima scrivere A :

$$A = \begin{pmatrix} 13 & 16 & 14 & 15 & 17 & 15 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

e quindi:

$$A_B = \begin{pmatrix} 13 & 16 & 14 & 15 & 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad A_N = \begin{pmatrix} 15 & 17 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

$$x_B = \left(1, 1, 1, \frac{14}{15}, 1, 1, \frac{1}{15}\right), \quad x_N = (0, 0, 0, 0, 0, 0)$$

e $r = 4, 7$;

5. Si ricava \tilde{A} :

$$\tilde{A} = A_B^{-1} A_N = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 & 1 \\ 1 & \frac{17}{15} & \frac{1}{15} & -\frac{13}{15} & -\frac{16}{15} & -\frac{14}{15} \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ -1 & -\frac{17}{15} & -\frac{1}{15} & \frac{13}{15} & \frac{16}{15} & \frac{14}{15} \end{pmatrix}$$

6. Si trovano due nuovi vincoli, notando che $N = \{4, 5, 7, 8, 9, 10\}$:

$$r = 4 \Rightarrow x_1 + 2x_2 + x_3 + x_4 + x_5 + x_6 \leq 4$$

$$r = 7 \Rightarrow 13x_1 + 15x_2 + 14x_3 + 14x_4 + 15x_5 + 14x_6 \leq 55$$

da qui in poi insicuro

17.1.3 Produzione

Supponiamo di avere il problema:

$$\begin{cases} \max 5x_1 + 14x_2 \\ 16x_1 + 13x_2 \geq 62 \\ 5x_1 + 15x_2 \geq 52 \\ x \in \mathbb{Z}_+^2 \end{cases}$$

con valutazioni:

$$x_{RC} = \left(\frac{26}{3}, 0\right), \quad v_S = 43$$

$$x_I = (8, 0), \quad v_I = 40$$

Si applica Gomory:

1. Convertiamo in formato duale standard:

$$\begin{cases} \max 5x_1 + 14x_2 \\ 16x_1 + 13x_2 - x_3 = 62 \\ 5x_1 + 15x_2 - x_4 = 52 \\ x \geq 0 \end{cases}$$

Dobbiamo ricalcolare l'ottimo:

$$x'_{RC} = \left(\frac{26}{3}, 0, \frac{230}{3}, 0\right)$$

2. Si individua la base ottima:

$$x'_{RC} = \left(\frac{26}{3}, 0, \frac{230}{3}, 0\right) \Rightarrow B = \{1, 3\}$$

3. Si ricavano A_B , A_N , x_B , x_N e r .

$$A_B = \begin{pmatrix} 16 & -1 \\ 5 & 0 \end{pmatrix}, \quad A_N = \begin{pmatrix} 13 & 0 \\ 15 & -1 \end{pmatrix}, \quad x_B = \left(\frac{26}{3}, \frac{230}{3}\right), \quad x_N = (0, 0)$$

e $r = 1, 3$;

4. Si ricava \tilde{A} :

$$\tilde{A} = A_B^{-1}A_N \Rightarrow ($$

5. Si trova il nuovo vincolo:

$$5x_1 + 13x_2 \geq 44$$