

Управление доходами.
(Revenue Managemt)
Лекции.
ЧЕРНОВИК

Лектор: Фридман Г.М.

Автор конспекта: Курмазов Ф.А.*

28 апреля 2021 г.

Содержание

1	Лекция 1. Введение в управление доходами.	2
1.1	Формулировка задачи.	2
1.2	Общая формулировка задачи определения оптимальной стратегии продаж авиакомпании. . . .	2
1.3	Простейшая модель оптимизации стратегии продаж авиакомпании.	2
2	Лекция 2. Имитационная модель.	3
2.1	Стратегии продаж.	3
2.2	Описание имитационной модели.	3
3	Лекция 3. Стохастические модели I. Уровни защиты и вложенные пределы бронирования.	4
3.1	Пределы бронирования.	4
3.2	Littlewood's rule.	4
3.3	EMSRb.	4
3.4	EMSRa.	4
4	Лекция 4. Стохастические модели II. Стохастические LP.	5
4.1	Probabilistic Non-Linear Problem (PNLP).	5
4.2	Randomized Linear Problem (RLP).	7
4.3	Demand forecasting, Censored Demand, Naive methods.	7

*Saint-Petersburg State University of Economics, Faculty of Informatics and Applied Mathematics.

1 Лекция 1. Введение в управление доходами.

1.1 Формулировка задачи.

Управление доходами (англ. Revenue Management) – область исследования операций, занимающаяся преимущественно моделированием и оптимизацией процессов, связанных с оптимизацией поведения производителя товаров/услуг на микро уровне. Основная цель – продажа правильного товара, правильному покупателю, в правильном месте, в правильное время, с целью максимизации роста выручки. Таким образом область сочетает в себе методы оптимизации, математической статистики, микро- и макроэкономики.

1.2 Общая формулировка задачи определения оптимальной стратегии продаж авиакомпании.

Авиакомпания предлагает на рынке O-D ряд продуктов, каждый из которых представляет собой комбинацию “маршрут – класс билета”, где класс билета – его цена. Спрос на каждый продукт, обычно, предсказывается заранее (вне данной модели), и обычно разбивается на несколько временных интервалов (DCP – data collection periods).

Авиакомпания хочет продавать все продукты таким образом, чтобы получить максимальных доход, учитывая при этом естественные ограничения вроде: заданный общий спрос, цена билетов, вместимость самолетов на рейсах, из которых состоят маршруты. Т.о. авиакомпания хочет найти оптимальную стратегию продаж, основанную на прогнозе спроса, физических ограничениях и реальном потоке запросов/покупателей.

1.3 Простейшая модель оптимизации стратегии продаж авиакомпании.

Заданы:

- Множество рейсов $Flights = [F]^1$
- Множество продуктов авиакомпании $G = [N]$.
- Вектор вместимости рейсов $Cap \in \mathbb{N}^F$
- Продукт $i \in G$ состоит из маршрута $Path_i \subseteq Flights$, при чем связного (путь в графе терминалов), и некоторой стоимости p_i (класс обслуживания).
- Вектор стоимостей продуктов $f \in \mathbb{R}^N$.
- Вектор спрогнозированного спроса на продукты $D \in \mathbb{N}^N$.

Цель задачи найти $x \in \mathbb{N}^N$ – количество продуктов каждого типа, которое компания разместит на рынке, максимизирующее выручку компании.

Пусть A – матрица $N \times F$, в которой $a_{i,j} = 1$, если i -й рейс входит в j -й продукт (i.e. содержится в нем в качестве маршрута), и $a_{i,j} = 0$ иначе.

Тогда линейная целочисленная программа соответствующая задаче может быть записана:

$$\begin{cases} f^T x & \rightarrow \max_x \\ Ax & \leq cap \\ x & \leq D \\ x \in \mathbb{N}_0^N \end{cases}$$

¹Здесь и далее, принята нотация $[n] = \{1, 2, 3, \dots, n\}$.

2 Лекция 2. Имитационная модель.

2.1 Стратегии продаж.

Шкалу времени можно разбить на периоды по DCP (англ. data collection points/periods) – точкам, в которых компания может принимать управленческие решения.

При использовании прогноза на спрос важно знать точность этого прогноза, для анализа эффективности выработанной стратегии.

Возможные стратегии продаж:

- Первый пришел - первый купил (англ. first come first served – FCFS).
- Оптимальная стратегия для одной начальной точки DCP (1DCP) – расчет стратегии в начале периода.
- Оптимальная стратегия для k точек DCP (kDCP) – пересчет стратегии в заданных k временных точках.

2.2 Описание имитационной модели.

Для имитации реального процесса продажи билетов можно принять поток запросов распределенным нормально, с параметрами $\mu = k_1 d_{it}$, $\sigma = k_2 \sqrt{d_{it}}$. Где k_1 , k_2 – ошибки прогноза мат. ожидания и ско соответственно.

Для каждого периода и для каждого вида товара можно сгенерировать (имитация) свой поток запросов на покупку. Каждый такой запрос может быть удовлетворен или отклонен, в зависимости от выбранной стратегии.

При каждом удовлетворении запроса требуется поддерживать естественные ограничения (т.е. уменьшать число оставшихся мест на рейсах).

По результату работы имитационной модели можно оценить отношение полученной выручки (в результате выбранной стратегии) к максимальной выручке, доступной при данном потоке требований.

3 Лекция 3. Стохастические модели I. Уровни защиты и вложенные пределы бронирования.

3.1 Пределы бронирования.

Предел бронирования (англ. booking limit) b – количество товара, которое компания готова продать в данном и меньших ценовых классах.

Пределы бронирования могут быть вложенными и невложенными.

Вложенные пределы бронирования предполагают, что компания готова продать товар меньшей стоимости по стоимости более дорогого товара. Тем не менее, компания заранее “ждет” заданное количество “богатых” покупателей, в связи с чем резервирует для них дорогой товар, и “защищает” его от покупки по меньшей стоимости.

Уровень защиты y (англ. protection levels) – сколько билетов защищено в данном и более высоких ценовых классах.

3.2 Littlewood’s rule.

Для выбора уровня защиты можно оценивать ожидаемую выручку от k -го билета дорогого класса, и сравнивать ее с ожидаемой выручкой при продаже этого билета по меньшей стоимости, в зависимости от распределения количества заявок на покупку того или иного класса.

Примером алгоритма выбора предела бронирования в ситуации с 2-мя ценовыми классами является правило Литтлвуда (Littlewood’s rule). При наличии 2-ух классов билетов, и при условии, что спрос на дешевый класс избыточен, можем положить, что спрос на дорогой класс имеет функцию распределения F . Тогда оценить количество мест, которое стоит зарезервировать под дорогой класс можно следующим образом:

$$limit = \max\{x \mid x \in \mathbb{N} \vee E[P(x)] = p_1 * F(x) > p_2\}$$

Перепроверить что тут вообще написано.

где p_1 p_2 цена на дорогой и на дешевый классы соответственно, $P(x)$ – прибыль от продажи дорогих билетов при пределе бронирования x .

Обобщением правила Литтлвуда на произвольное число ценовых классов являются эвристические алгоритмы выбора вложенных пределов бронирования, носящие общее название EMSR (Expected Marginal Set Revenue).

3.3 EMSRb.

Применяем правило Литтлвуда к частичным массивам (к подмассивам с 1-го элемента по k -й) последовательно идущих ценовых классов (т.е. некоторого супер-класса) и следующему классу за ними. Т.о. получим массив уровней защиты для всех ценовых классов. При этом, супер-класс – агрегированный набор классов – может быть распределен как его участники взятые с разными весами.

...

3.4 EMSRa.

Применяем правило Литтлвуда для каждого 2-ух последовательно идущих ценовых классов (от большего к меньшему), а затем берем массив частичных сумм полученных уровней защиты в качестве уровней защиты всех ценовых классов.

...

4 Лекция 4. Стохастические модели II. Стохастические LP.

4.1 Probabilistic Non-Linear Problem (PNLP).

$$(DLP) : \begin{cases} f^T x \rightarrow \max \\ Ax \leq Cap \\ 0 \leq x \leq \mathbb{E}(\mathfrak{D}) \end{cases} \quad (PNLP) \begin{cases} \sum_{j=1}^n f_j \mathbb{E}(\mathfrak{b}_j) \rightarrow \max \\ Ax \leq Cap \\ x \geq 0 \end{cases}$$

где N – количество товаров, F – количество рейсов, \mathfrak{D} – вектор спроса (\mathfrak{D}_j – спрос на j продукт – дискретная положительная случайная величина), \mathbb{E} – мат. ожидание, $f \in \mathbb{R}^N$ – вектор цен, $A \in \{0, 1\}^{F \times N}$ – матрица маршрутов, $Cap \in \mathbb{Z}^F$ – вектор вместимости, x – переменная, обозначающая объемы продукции.

Мы можем предположить, что нам известен закон распределения $\mathfrak{D}_j \sim F_j$, что эквивалентно тому, что известны $Pr[\mathfrak{D}_j = s] \forall s \in \{0, 1, 2, \dots\}$.

Интерпретируем переменную x_j – как количество товара j , которое мы хотим продать. Введем СВ b_j – количество продукта j , которое будет продано, при условии заданного x_j . Таким образом b_j – дискретная случайная величина, которая принимает целочисленные значения от 0 до x_j . На самом деле, $b_j = \min(x_j, \mathfrak{D}_j)$, т.к. мы не можем продать больше заготовленного объема x_j . Тогда можем выразить вероятность:

$$Pr[b_j = s] = \begin{cases} Pr[\mathfrak{D}_j = s] & 0 \leq s < x_j \\ Pr[\mathfrak{D}_j \geq x_j] & s = x_j \\ 0 & s > x_j \end{cases}$$

Откуда следует также:

$$\begin{aligned} Pr[b_j \geq s] &= Pr[\mathfrak{D}_j \geq s] \quad 0 \leq s < x_j \\ Pr[b_j = x_j] &= Pr[b_j \geq x_j] = Pr[\mathfrak{D}_j \geq x_j] \end{aligned}$$

Приведем определение математического ожидания дискретной СВ ξ со значениями $\{0, 1, 2, 3, \dots, S\}$:

$$\mathbb{E}[\xi] = \sum_{s=0}^S s Pr[\xi = s] = Pr[\xi = 1] + 2 Pr[\xi = 2] + \dots + S Pr[\xi = S]$$

Перегруппировкой слагаемых легко можно получить формулу

$$\mathbb{E}[\xi] = \sum_{s=1}^S Pr[\xi \geq s] \quad (1)$$

Можно воспользоваться ей и расписать математическое ожидание b_j :

$$\mathbb{E}[b_j] = \sum_{s=1}^{x_j} s Pr[b_j = s] = \sum_{s=1}^{x_j} Pr[b_j \geq s] = \sum_{s=1}^{x_j} Pr[\mathfrak{D}_j \geq s]$$

Введем новое обозначение, и перепишем полученную формулу:

$$\begin{aligned} P_{j,s} &:= Pr[\mathfrak{D}_j \geq s] \quad s = 1, 2, \dots, x_j \\ \mathbb{E}[b_j] &= \sum_{s=1}^{x_j} P_{j,s} \end{aligned} \quad (2)$$

Тогда получим целевую функцию (для PNLП):

$$\sum_{j=1}^n f_j \mathbb{E}[b_j] = \sum_{j=1}^n f_j \sum_{s=1}^{x_j} P_{j,s} \rightarrow \max \quad (3)$$

Но работать с дискретными случайными величинами не всегда удобно. В связи с чем можно перейти к непрерывным. В частности, можно предположить, что спрос распределен нормально.²

$$\mathbb{D}_j \sim \mathcal{N}(\mu_j, \sigma_j) \quad \forall j \in [N]$$

$$\mathcal{N}(\mu, \sigma, x) = \frac{1}{2} (1 + \operatorname{erf}(\frac{x - \mu}{\sqrt{2}\sigma}))$$

Переходим к аппроксимации дискретного распределения нормальным:

$$P_{j,s} = \Pr[\mathbb{D}_j \geq s] \approx 1 - \mathcal{N}(\mu_j, \sigma_j, s)$$

$$\mathbb{E}[b_j] = \sum_{s=1}^{x_j} (1 - \mathcal{N}(\mu_j, \sigma_j, s))$$

$$\sum_{j=1}^N f_j \mathbb{E}[b_j] = \sum_{j=1}^N f_j \sum_{s=1}^{x_j} (1 - \mathcal{N}(\mu_j, \sigma_j, s))$$

Но иметь переменный предел суммирования для задачи оптимизации не очень удобно. Обозначим (для удобства нотации) $\max Cap := \max_k Cap_k$.³ Переформулируем задачу так, чтобы избавиться от верхнего предела суммирования. Введем наборы монотонных бинарных переменных $x_{j,s}$ для $s \in [\max Cap]$.

$$\begin{cases} x_{j,s} = \begin{cases} 1 & \text{для продукта } j \text{ продаем билет } s \\ 0 & \text{else} \end{cases} \\ x_{j,s+1} - x_{j,s} \leq 0 \quad \forall s \in [\max Cap - 1] \end{cases}$$

Дальше (а может и перед) точно есть ошибки в индексах и в целом.

С новой целевой функцией:

$$\sum_{j=1}^n f_j \sum_{s=1}^{\max Cap} x_{j,s} (1 - \mathcal{N}(\mu_j, \sigma_j, s)) \rightarrow \max$$

И новым ограничением вместимости:

$$\sum_{j: F_j \ni k} \sum_{s=1}^{\max Cap} x_{j,s} \leq Cap_k \quad \forall k \in [F]$$

Получим 0-1 формулировку (PNLP):

$$(0-1 \text{ PNLП}) \begin{cases} \sum_{j=1}^n f_j \sum_{s=1}^{\max Cap} x_{j,s} (1 - \mathcal{N}(\mu_j, \sigma_j, s)) \rightarrow \max \\ \sum_{j: F_j \ni k} \sum_{s=1}^{\max Cap} x_{j,s} \leq Cap_k & \forall k \in [F] \\ x_{j,s+1} - x_{j,s} \leq 0 & \forall j \in [N], \forall s \in [\max Cap - 1] \\ x_{j,s} \in \{0, 1\} & \forall j \in [N], \forall s \in [\max Cap] \end{cases}$$

где F_j – рейсы, которые включает в себя j -й товар.

²Здесь и далее, немного злоупотребляем нотацией, и отождествляем некоторое распределение \mathcal{A} с приписанным дополнительным аргументом x (т.е. $\mathcal{A}(\dots, x)$) с функцией распределения \mathcal{A} .

³Такой подход при реализации модели добавит лишних переменных, но зато при ее описании поможет сократить лишние индексы.

4.2 Randomized Linear Problem (RLP).

$$(\text{RLP}) : \begin{cases} f^T x \rightarrow \max \\ Ax \leq Cap \\ 0 \leq x \leq \mathfrak{D}^i \end{cases}$$

где \mathfrak{D}^i – конкретная реализация спроса.

Модель (RLP) запускается как множество экспериментов, а финальный ответ берется в виде среднего по всем решениям $x^* = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x^{*i}$, с последующим *умным* округлением каждой координаты.

4.3 Demand forecasting. Censored Demand. Naive methods.

На практике, с целью прогнозирования спроса, могут быть использованы исторические данные (временные ряды). Но у этого подхода есть проблема. Исторические данные о спросе являются цензурированными. Другими словами, мы можем разделить точки исторического периода на истинные и цензурированные, где истинный спрос – весь исторический спрос, меньший предела продаж в ту же дату, а цензурированный – точки, в которых количество продаж равно пределу. Это связано с тем, что мы никак не можем отследить спрос, превышающий предел продаж.

В связи с этим возникает отдельная проблема – оценить распределение спроса в условиях цензурированных исторических данных. Существует множество методов. Рассмотрим наивные:

Naive 1: все цензурированные элементы заменить на среднее по всей выборке. Получим \pm хорошее μ , но плохое σ , за счет потери дисперсии.