

Sprawozdanie - Metody numeryczne i optymalizacja

Jakub Andryszczak 259519,
Jakub Żak 244255,
Maciej Cierpisz 249163

Spis treści

1	Zadanie nr. 1	3
2	Zadanie nr. 2	5
3	Zadanie nr. 3	5
4	Zadanie nr. 4	5
5	Zadanie nr. 5	7
6	Zadanie nr. 6	8

1 Zadanie nr. 1

Znajdź liczby x_1 i x_2 , które maksymalizują sumę $x_1 + x_2$ przy ograniczeniach:

$$\begin{cases} x_1 \geq 0, x_2 \geq 0 \\ x_1 + 2x_2 \leq 2 \\ 4x_1 + 2x_2 \leq 12 \\ -x_1 + x_2 \leq 1, \end{cases} \quad (1)$$

Narysować zbiór dopuszczalnych rozwiązań na \mathbb{R}^2 i znaleźć rozwiązanie w ujęciu geometrycznym, formułując zadanie programowania liniowego.

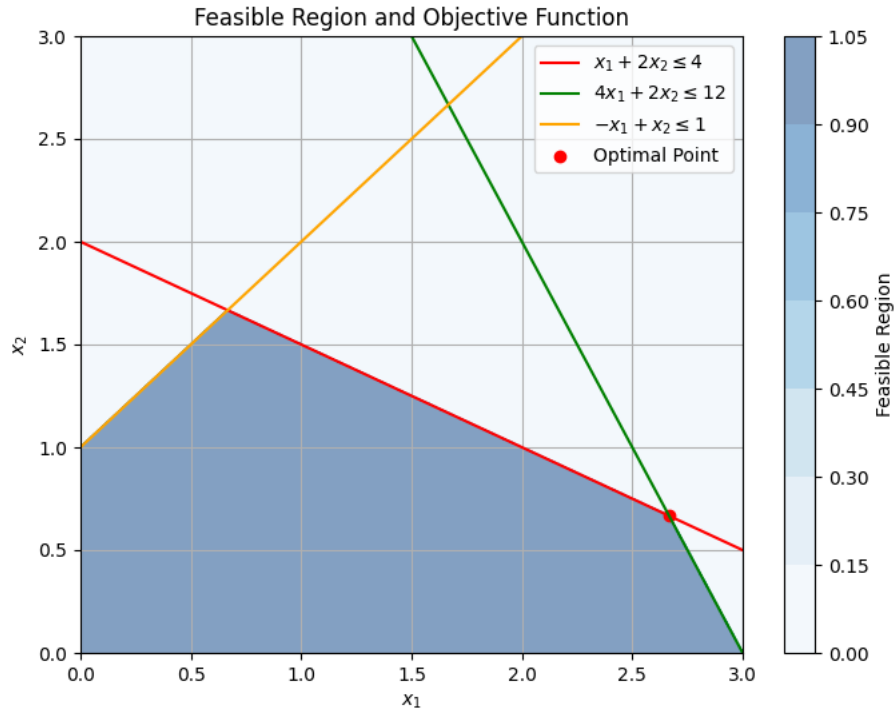
Początkowo zapisano wszystkie nierówności w formie równań z dodatkową niewiadomą,

$$\begin{cases} x_1 + 2x_2 + x_3 = 2 \\ 4x_1 + 2x_2 + x_4 = 12 \\ -x_1 + x_2 + x_5 = 1, \end{cases} \quad (2)$$

Zapisano zadanie w postaci macierzowej:

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 0 & 0 & 4 \\ 4 & 2 & 0 & 1 & 0 & 12 \\ -1 & 1 & 0 & 0 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} \quad (3)$$

Następnie wyświetlono wszystkie proste na jednym wykresie.



Wykres.2.1. Zależność n-tej iteracji metody do błędu residualnego

Obszar zamalowany jest zbiorem dopuszczalnych rozwiązań dla podanych warunków zadania. Liczby x_1 i x_2 , które maksymalizują ich sumę przy podanych ograniczeniach są:

$$\begin{cases} x_1 = 2.6667 \\ x_2 = 0.6667 \\ f(x_1, x_2) = 3.3333 \end{cases} \quad (4)$$

Kolejno zweryfikowano czy znalezione rozwiązanie jest poprawne. Do tego wykorzystano funkcję `linprog(.)`. Zauważono, że wyniki są spójne. Wykonano obliczenia również na samodzielnie wykonanej funkcji, aby porównać czas i dokładność względem funkcji `linprog`.

Czas w jakim została wykonana ręcznie wykonana funkcja bez wykorzystania `linprog`: 0.0004387 [s]

Czas w jakim została wykonana funkcja z wykorzystania `linprog`: 0.0020085 [s]

W każdym przypadku wychodzi ten sam spójny wynik.

2 Zadanie nr. 2

Zrównoważona normalna dieta zakłada, że codziennie powinniśmy spożywać co najmniej 60 gramów białka i co najmniej 120 gramów węglowodanów. Zakładamy, że 100 gram sera zawiera 20 gramy białka i 20 gramy węglowodanów, natomiast taka sama ilość chleba zawiera 10 gram białka i 30 gramy węglowodanów. Proszę wyznaczyć najbardziej ekonomiczną dietę przy założeniu, że cena sera wynosi 30 zł/kg, a chleba 20 zł/kg.

Kod realizujący zadanie:

```
from pulp import *

# Definicja problemu
problem = LpProblem("Zrównoważona normalna dieta")

# Zmienne decyzyjne
x = LpVariable("x", lowBound=0)
y = LpVariable("y", lowBound=0)

# Funkcja celu
problem += 30 * x + 20 * y, LpMinimize

# Ograniczenia
problem += 20 * x + 10 * y >= 60
problem += 20 * x + 30 * y >= 120

# Rozwiązanie problemu
problem.solve()

# Śświetlenie wyników
print("śĆIlo sera:", x.value())
print("śĆIlo chleba:", y.value())
print("Koszt diety:", problem.objective.value())
```

Wyniki obliczeń przedstawiono w formie tabeli:

Ilość sera	1,5 kg
Ilość chleba	3 kg
Koszt diety	105 zł

3 Zadanie nr. 3

4 Zadanie nr. 4

W pewnej rafinerii proces rafinacji wymaga wyprodukowania co najmniej dwóch litrów benzyny na każdy litr oleju opałowego. Aby sprostać przewidywanemu zapotrzebowaniu w okresie zimowym, trzeba będzie produkować co

najmniej trzy miliony litrów oleju opałowego dziennie. Z kolei, zapotrzebowanie na benzynę wynosi nie więcej niż 6,4 miliona litrów dziennie. Jeśli benzynę sprzedaje się po 1,90 dolara za litr, a olej opałowy po 1,50 dolara za litr, to ile należy wyprodukować każdego z tych produktów, aby zmaksymalizować przychody?

Aby rozwiązać zadania, sformułowano funkcję celu, którą chcemy zmaksymalizować. Dla x_1 oznaczamy litry oleju opałowego, a x_2 litry benzyny, które należy wyprodukować. Przychody można obliczyć jako iloczyn ilości litrów każdego produktu i odpowiadających im cen:

$$f(x_1, x_2) = 1.5x_1 + 1.9x_2 \quad (5)$$

Należy wyprodukować co najmniej trzy miliony litrów oleju opałowego, a proces rafinacji wymaga wyprodukowania co najmniej dwóch litrów benzyny na każdy litr oleju opałowego, a ograniczenie zapotrzebowania na benzynę wynosi nie więcej niż 6,4 miliona litrów dziennie, więc

$$\begin{cases} x_1 \geq 3 \\ x_2 \leq 6.4 \\ -2x_1 + x_2 \geq 0 \end{cases} \quad (6)$$

Następnie przekształcono nierówności na równania z dodatkową niewiadomą i zapisano w postaci macierzowej

$$\begin{bmatrix} -1 & 0 & 1 & 0 & 0 & -3 \\ 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 6.4 \\ -1 & 2 & 0 & 0 & 1 & 0 \\ 1.9 & 1.5 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix} \quad (7)$$

Wykorzystano algorytmy z wcześniejszych zadań do rozwiązania tego zadania a następnie porównano wyniki.

Dla funkcji bez linprog:

$$\begin{cases} x_1 = 3.2 \\ x_2 = 6.4 \\ f(x_1, x_2) = 16.96 \\ Czas : 0.0004787[s] \end{cases} \quad (8)$$

Dla funkcji z linprog:

$$\begin{cases} x_1 = 3.2 \\ x_2 = 6.4 \\ f(x_1, x_2) = 16.96 \\ Czas : 0.0016223[s] \end{cases} \quad (9)$$

Można zauważyć, że tak samo jak w zadaniu 1 czas wykonania się funkcji z linprog jest dłuższy. Może to być związane z poziomem rozbudowania tej metody.

5 Zadanie nr. 5

Załóżmy, że mamy do zainwestowania 12 000 USD i trzy różne fundusze do wyboru. Fundusz obligacji komunalnych ma stopę zwrotu 7%, lokata bankowa ma stopę zwrotu 8%, a konto wysokiego ryzyka ma oczekiwaną (spodziewaną) stopę zwrotu 12%. Aby zminimalizować ryzyko, postanawiasz nie inwestować więcej niż 2000 USD na koncie wysokiego ryzyka. Ze względów podatkowych musisz zainwestować co najmniej trzy razy więcej w obligacje komunalne niż w lokatę bankową. Zakładając, że zyski na koniec roku będą zgodne z oczekiwaniami, jakie są optymalne kwoty inwestycji?

Kod realizujący zadanie:

```
import pulp

# Inicjalizacja problemu
prob = pulp.LpProblem("Maximize Returns", pulp.LpMaximize)

# Zmienne decyzyjne
x1 = pulp.LpVariable("Obligacje", lowBound=0) # Inwestycja w fundusz
      obligacji
x2 = pulp.LpVariable("Depozyt", lowBound=0) # Inwestycja w lokat bankową
x3 = pulp.LpVariable("Wysokie ryzyko", lowBound=0, upBound=2000) #
      Inwestycja w konto wysokiego ryzyka

# Funkcja celu - maksymalizacja zwrotów
prob += 0.07 * x1 + 0.08 * x2 + 0.12 * x3, "Total_Returns"

# Ograniczenia
prob += x1 >= 3 * x2 # Inwestycja w obligacje komunalne musi być co
      najmniej trzy razy większa niż w lokat bankową
prob += x1 + x2 + x3 <= 12000 # Suma inwestycji nie może przekroczyć
      12000 USD

# Rozwiązanie problemu
prob.solve()

# Wyświetlenie wyników
print("Optymalne kwoty:")
for v in prob.variables():
    print(v.name, "=", "{:,.2f}".format(v.varValue))

print("Szacowana stopa zwrotu =
      {:,.2f}".format(pulp.value(prob.objective)))
```

Wyniki obliczeń przedstawiono w formie tabeli:

Depozyt	2500 \$
Obligacje	7500 \$
Wysokie ryzyko	2000 \$
Szacowana stopa zwrotu	965 \$

6 **Zadanie nr. 6**