

Notes of Operational Research

June 30, 2019

Abstract

1 运筹学概述

2 线性规划

2.1 线性规划的概念

2.1.1 线性规划问题的导出

2.1.2 线性规划的定义和数学描述

定义：目标函数和约束都是决策变量的线性表达式

- 目标要求/目标函数
- 限制条件/约束条件
- 非负条件
- 线性表达式（未知变量：决策变量）

e.g.

$$\begin{aligned} \max(\min) Z &= c_1x_1 + c_2x_2 + \cdots + c_nx_n \\ s.t. \quad &\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \cdots + a_{1n}x_n \leq (=, \geq) b_1 \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \cdots + a_{2n}x_n \leq (=, \geq) b_2 \\ \cdots \\ x_1 \geq 0, x_2 \geq 0, \cdots, x_n \geq 0 \end{cases} \end{aligned} \quad (1)$$

- 线性规划模型的一般形式
- 线性规划模型的紧缩形式
- 线性规划模型的矩阵形式
- 线性规划模型的向量-矩阵形式

2.1.3 线性规划的标准型

- 目标函数极大化 max
- 约束条件必须为等式
- 约束条件右端的常数必须为非负数
- 决策变量大于等于 0

将线性规划问题化为标准型：

e.g.

$$\begin{aligned} \min Z &= -x_1 + 5x_2 - 2x_3 \\ \text{s.t.} \quad &\begin{cases} x_1 + x_2 - x_3 \leq 6 \\ 2x_1 - x_2 + 3x_3 \geq 5 \\ x_1 + x_2 = 10 \\ x_1 \geq 0, x_2 \leq 2, x_3 \end{cases} \end{aligned} \quad (2)$$

- 1) x_3 , 令 $x_3 = x'_3 - x_4$;
- 2) x_2 , 令 $x_2 = -x'_2, x'_2 \geq 0$;
- 3) 约束 1 引松弛变量;
- 4) 约束 2 引剩余变量;
- 5) 目标函数标准化, 引入变换 $Z' = -Z$;
- 6) 整理。

Obtain:

$$\begin{aligned} \max Z' &= x_1 - 5(-x'_2) + 2(x'_3 - x_4) + 0x_5 + 0x_6 \\ \text{s.t.} \quad &\begin{cases} x_1 + (-x'_2) - (x'_3 - x_4) + x_5 = 6 \\ 2x_1 - (-x'_2) + 3(x'_3 - x_4) - x_6 = 5 \\ x_1 + (-x'_2) = 10 \\ x_1, x'_2, x'_3, x_4, x_5, x_6 \geq 0 \end{cases} \end{aligned} \quad (3)$$

Final result:

$$\begin{aligned} \max Z' &= x_1 + 5x'_2 + 2x'_3 - 2x_4 \\ \text{s.t.} \quad &\begin{cases} x_1 - x'_2 - x'_3 + x_4 + x_5 = 6 \\ 2x_1 + x'_2 + 3x'_3 - 3x_4 - x_6 = 5 \\ x_1 - x'_2 = 10 \\ x_1, x'_2, x'_3, x_4, x_5, x_6 \geq 0 \end{cases} \end{aligned} \quad (4)$$

2.2 线性规划的各种解和性质

- 可行解：满足约束条件和非负条件的决策变量的一组取值。
- 最优解：使目标函数达到最优解的可行解。
- 基本解：设 $AX = b$ 是含 n 个决策变量、 m 个约束条件的 LP 的约束方程组, B 是 LP 问题的一个基, 若令不与 B 的列相应的 $n - m$ 个分量 (非基变量) 都等于零, 所得的方程组的解称为方程组 $AX = b$ 关于基 B 的基本解, 简称 LP 的基本解。

基本解定义：令 X 满足 $AX = b$ ，若 $X \neq 0$ ，则 X 必有非零分量 x_α, x_β, \dots ，于是必存在方程式：

$$AX = x_\alpha a^\alpha + x_\beta a^\beta + \dots = b$$

其中， a^α, a^β, \dots 为与 x_α, x_β, \dots 对应的 A 阵列矢量，如果列矢量 a^α, a^β, \dots 之间线性独立，则称 X 为基本解。若存在多个不同的非零基本解，则他们之间组合系数之和为 1 的线性组合也必是方程解，即方程必存在无穷多个解。

基本可行解：满足等式约束 $AX = b$ 及自变量限制 $X \geq 0$ 的解称为可行解，既是可行解又是基本解的解称为基本可行解。基本可行解是可行域的顶点，是满足非负条件的基本解。

基本最优解（对应的基为最优基）：使目标函数达到最优值的基本可行解。

e.g.

1. 可行解：对问题 (LP)

$$\begin{aligned} \max z &= CX \\ \text{s.t.} \quad &\begin{cases} AX = b \\ X \geq 0 \end{cases} \end{aligned}$$

若 $x_0 = (x_1^0, x_2^0, \dots, x_n^0)$ 满足约束方程 $\begin{cases} AX = b \\ X \geq 0 \end{cases}$ ，则称 x_0 为问题 (LP) 的一个可行解。

2. 可行域：(LP) 的全体可行解构成的集合称为可行域，即：可行域 $S = \{X | AX = b, x \geq 0\}$ 。

3. 最优解及最优值：设 S 是 (LP) 的可行域，若存在 $X^* \in S$ ，使得对任意的 $X \in S$ ，都有 $CX^* \geq CX$ ，则称 X^* 为问题 (LP) 的最优解， $Z^* = CX^*$ 称为问题 (LP) 的最优值。

4. 若对任意大的 $M > 0$ ，都存在可行解使得该线性规划的目标函数值 $|Z| \geq M$ ，则称该线性规划问题无界。

5. 基与基本可行解：设 B 是 (LP) 问题的一个基，令非基变量取零可得 $AX = b$ 的一个解 $X = \begin{pmatrix} B^{-1}b \\ 0 \end{pmatrix}$ ，称此解为对应于基 B 的基本解。

注意：若 $B^{-1}b \geq 0$ ，则 $X \geq 0$ 即 X 是 (LP) 问题的基本可行解；若 $B^{-1}b < 0$ ，则 $X < 0$ 即 X 不是 (LP) 问题的基本可行解。

6. 基本可行解定义：满足 $X_B = B^{-1}b \geq 0$ 的基本解 $\begin{pmatrix} B^{-1}b \\ 0 \end{pmatrix}$ 称为基本可行解，对应的基称为可行基。基本可行解的个数 $\leq C_n^m$ ， m 为限制条件的个数， n 为决策变量的个数。

e.g. 对线性规划问题，

$$\begin{aligned} \max z &= 7x_1 + x_2 \\ \text{s.t.} \quad &\begin{cases} x_1 + 2x_2 \leq 6 \\ x_1 - x_2 \leq 1 \\ x_1 \leq 2 \\ x_1, x_2 \geq 0 \end{cases} \end{aligned}$$

解：其标准型为

$$\begin{aligned} \max z &= 7x_1 + x_2 \\ \text{s.t.} \quad &\begin{cases} x_1 + 2x_2 + x_3 = 6 \\ x_1 - x_2 + x_4 = 1 \\ x_1 + x_5 = 2 \\ x_1, x_2, x_3, x_4, x_5 \geq 0 \end{cases} \end{aligned}$$

$$\text{系数矩阵 } A = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 1 & 0 & 0 \\ 1 & -1 & 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} = (P_1 \ P_2 \ P_3 \ P_4 \ P_5)$$

So, 该问题的基 ($r=3$ 且行列式不为零) 有:

$$B_1 = (P_1 \ P_2 \ P_3), \text{ 基变量 } X_{B_1} = (x_1 \ x_2 \ x_3)', \text{ 非基变量 } X_{N_1} = (x_4 \ x_5)'$$

$$B_2 = (P_3 \ P_4 \ P_5), \text{ 基变量 } X_{B_2} = (x_3 \ x_4 \ x_5)', \text{ 非基变量 } X_{N_2} = (x_1 \ x_2)'$$

$$\dots$$

以 B_1 为例, $B_1 = (P_1 \ P_2 \ P_3)$ 为基, $N_1 = (P_4 \ P_5)$ 非基

基变量 $X_{B_1} = (x_1 \ x_2 \ x_3)'$, 非基变量 $X_{N_1} = (x_4 \ x_5)'$

令非基变量 $X_{N_1} = (x_4 \ x_5)' = 0$, 得 $x_1 = 2, x_2 = 1, x_3 = 2$

对应基 B_1 的基本解: $X_1 = (2 \ 1 \ 2 \ 0 \ 0)'$ 。

2.3 线性规划的图解法和解的几何表示

2.3.1 图解法

1. 线性规划的图解法: 就是用几何作图的方法分析并求出其最优解的过程。

2. 求解的思路

1) 先将约束条件加以图解, 求得满足约束条件的解的集合 (即可行域)

2) 然后结合目标函数的要求从可行域中找出最优解。

3. 线性规划的可行域一定是凸多边形或凸多面体。4. 有关线性规划解的结论:

1) 若 (LP) 问题有可行解, 则可行域是一个凸多边形 (或凸多面体)。它可能是有界的; 也可能是无界的。

2) 若 (LP) 问题有最优解, 则最优解可能是唯一的; 也可能是无穷多个。如果是唯一的, 这个解一定在该凸多边形的某个顶点上; 如果是无穷多个, 则这些最优解一定充满凸多边形的一条边界 (包括此边界的两个顶点)。

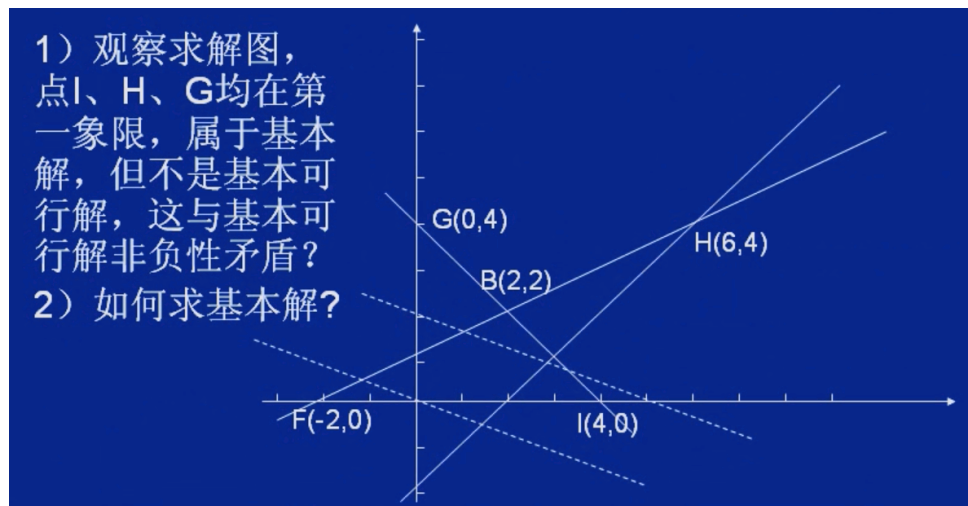
3) 若 (LP) 问题有可行解, 但没有有限最优解, 此时凸多边形是无界的。

4) 若 (LP) 问题没有可行解, 则该问题没有最优解。

2.3.2 基本可行解的几何意义

1. e.g.

$$\begin{aligned} \max Z &= 2x_1 + 5x_2 \\ \text{s.t. } \begin{cases} x_1 + x_2 \leq 4 \\ -x_1 + 2x_2 \leq 2 \\ x_1 - x_2 \leq 2 \\ x_1, x_2 \geq 2 \end{cases} \end{aligned} \quad (5)$$



第一步模型标准化：需增加 (x_3, x_4, x_5) 三个额外变量

第二部按照基本解的定义

- 找基。不超过 C_5^3
- 确定基变量和非基变量；
- 令非基变量为 0，解出基变量；
- 基变量和相应非基变量搭配构成基本解。

$H(6, 4, -6, 0, 0)^T, C(3, 1, 0, 3, 0)^T, B(2, 2, 0, 0, 2)^T, D(2, 0, 2, 4, 0)^T, F(-2, 0, 6, 0, 4), I(4, 0, 0, 6, -2)^T, E(0, -2, 6, 6, 0)^T, A(0, 1, 3, 0, 3)^T, G(0, 4, 0, -8, 6)^T, O(0, 0, 4, 2, 2)^T$

H, I, G 三点虽满足 $x_1, x_2 \geq 0$ ，但不满足 $x_3, x_4, x_5 \geq 0$ ，所以 H, I, G 是基本解而不是基本可行解。

2. 结论：

- 基本解对应所有可行域边界延长线、坐标轴之间的交点；
- 基本可行解对应可行域的顶点。

3. 基本可行解包括退化基本可行解和非退化基本可行解。

退化基本可行解：基本可行解中，存在取 0 值的基变量，对应的基称为退化基。

非退化基本可行解：基本可行解中，基变量的取值均大于 0，对应的基称为非退化基。

4. 线性规划问题分为退化的线性规划问题和非退化的线性规划问题。

2.3.3 线性规划解的性质

1. 基本概念：

- 凸集
- 凸组合
- 顶点