

MEM-293 Θωρία Βεταροποινου

10^η εξ αποστάσεως διαλέξη

Δευτέρα 4/5/2020

(5μμ-7μμ)

Zoom.

Έστω x^B μια μη εκφυλισμένη βασική λύση και $(x_j^B)_{j \in I}$ οι βασικές συντεταγμένες της.

(B.10.1)

Ας υποθέσουμε ότι στις βασικές στήλες $B = (a_i)_{i \in I}$ εισέρχεται η a_{j_0} και εισέρχεται η a_{k_0} . Για το επόμενο βήμα (ταβλακιά) της μεθόδου Simplex χρειάζεται να υπολογίσουμε τους συντελεστές των στηλών του A ως προς τη νέα βάση $\tilde{B} = \{a_i : i \in (I \setminus \{j_0\}) \cup \{k_0\}\}$.

Έστω a_μ μια στήλη του A . Η αναπαράσταση του a_μ ως προς την παλιά βάση $(a_i)_{i \in I}$ είναι:

$$a_\mu = \sum_{j \in I} \gamma_j^\mu a_j = \sum_{\substack{j \in I \\ j \neq j_0}} \gamma_j^\mu a_j + \gamma_{j_0}^\mu a_{j_0} \quad (1)$$

Έτσι για τη στήλη a_{k_0} που εισέρχεται στη βάση έχουμε:

$$a_{k_0} = \sum_{j \in I} \gamma_j^{k_0} a_j = \sum_{\substack{j \in I \\ j \neq j_0}} \gamma_j^{k_0} a_j + \underbrace{\gamma_{j_0}^{k_0}}_{\text{σδημός}} a_{j_0}$$

$$\Rightarrow a_{j_0} = \frac{1}{\gamma_{j_0}^{k_0}} a_{k_0} - \sum_{\substack{j \in I \\ j \neq j_0}} \frac{\gamma_j^{k_0}}{\gamma_{j_0}^{k_0}} a_j \quad (2)$$

Συνδυάζοντας τις (1) και (2), έπεται
$$a_\mu = \sum_{\substack{j \in I \\ j \neq j_0}} \gamma_j^\mu a_j + \gamma_{j_0}^\mu \left[\frac{1}{\gamma_{j_0}^{k_0}} a_{k_0} - \sum_{\substack{j \in I \\ j \neq j_0}} \frac{\gamma_j^{k_0}}{\gamma_{j_0}^{k_0}} a_j \right] \Rightarrow$$

↓ οι βασικές συντεταγμένες
των a_μ ως προς αντάλλαξη

(B.10.2α)

$$\Rightarrow a_\mu = \sum_{\substack{j \in I \\ j \neq j_0}} \left(y_j^\mu - y_{j_0}^\mu \cdot \frac{y_j^{k_0}}{y_{j_0}^{k_0}} \right) a_j + \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} a_{k_0} = \sum_{j \in (I \setminus \{j_0\}) \cup \{k_0\}} \tilde{y}_j^\mu a_j$$

$$\Rightarrow \tilde{y}_j^\mu = \begin{cases} y_j^\mu - \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} y_j^{k_0}, & j \in I \setminus \{j_0\} \\ \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}}, & j = k_0 \end{cases}$$

← "ανά τα j "
← "ρέο j "

το $y_{j_0}^{k_0}$ κερδίζεται
"οδηγός (pivot)"

Ξέρουμε ότι $z^k - c_k = 0$ όταν $k \in I$. Το επόμενο είναι πως αλλάζουν τα $z^k - c_k$ όταν αλλάξει η βάση

$$\begin{aligned} \tilde{z}^\mu - c_\mu &= f(\tilde{y}^\mu) = c_{k_0} \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} + \sum_{\substack{j \in I \\ j \neq j_0}} c_j \left(y_j^\mu - \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} y_j^{k_0} \right) = \sum_{\substack{j \in I \\ j \neq j_0}} c_j y_j^\mu - \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} \sum_{\substack{j \in I \\ j \neq j_0}} c_j y_j^{k_0} + c_{k_0} \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} \\ &= f(y^\mu) - c_{j_0} y_{j_0}^\mu - \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} (f(y^{k_0}) - c_{j_0} y_{j_0}^{k_0}) + c_{k_0} \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} \\ &= f(y^\mu) - \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} f(y^{k_0}) + c_{k_0} \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} \end{aligned}$$

Αρα:

$$\tilde{z}^\mu - c_\mu = (z^\mu - c_\mu) - \frac{y_{j_0}^\mu}{y_{j_0}^{k_0}} (z^{k_0} - c_{k_0})$$

tableau 2

	C	C ₁	C ₂	C ₃	C ₄	C ₅	
B	C _B	z ^B	a ₁	a ₂	a ₃	a ₄	a ₅
a ₁	C ₁	w ₁ ^B	$\frac{y_{11}^B}{y_{31}^B}$	$\frac{y_{21}^B}{y_{31}^B}$	$\frac{y_{31}^B}{y_{31}^B}$	$\frac{y_{41}^B}{y_{31}^B}$	$\frac{y_{51}^B}{y_{31}^B}$
a ₄	C ₄	w ₄ ^B					
a ₅	C ₅	w ₅ ^B					
		f(w ^B)					
			0	0	0	z ^k	z ^k - c _k

$(z^i - c^i) - \frac{y_{3i}^B}{y_{31}^B} (z^1 - c^1)$
 tableau 1

maxima z^k οδηγός

Στο προηγούμενο tableau 1 κατά μήκος της στήλης α₁ εισέρχεται στη βάση στη θέση της α₃. Στο επόμενο tableau 2 κάνουμε τα ακόλουθα:

- Βάζουμε το α₁ στη θέση του α₃ στη στήλη κάτω από το B.
- Στη στήλη κάτω από το z^B βάζουμε τη νέα βασική επιλογή w^B που βρήκαμε.
- Οι συντελεστές στη γραμμή κριτικής από το α₁ (γραμμή 1) προκύπτουν διαιρώντας τους συντελεστές της γραμμής δίπλα από το α₃ στο tableau 1 με τον οδηγό $\frac{y_{31}^B}{y_{31}^B}$.

• Στη γραμμή δίπλα από το α₄ σαν α_i στην α₁ στήλη θα έχουμε την τιμή $\frac{y_{41}^B}{y_{31}^B}$ του tableau 1 στο ίδιο κουτάκι με τον $\frac{y_{51}^B}{y_{31}^B}$ που βρίσκουμε στο κουτάκι της γραμμής δίπλα στην α₁ και κάτω από την α_i στήλη του tableau 2 πολλαπλασιάζουμε από την τιμή $\frac{y_{41}^B}{y_{31}^B}$ που είναι ο συντελεστής κάτω από την στήλη α₁ στη γραμμή δίπλα από το α₄, δηλ. $\frac{y_{41}^B}{y_{31}^B} - \frac{y_{41}^B}{y_{31}^B} \cdot \frac{y_{41}^B}{y_{31}^B}$.

- Ανάλογα πράττουμε στη γραμμή α₅ (δηλ 5 στη θέση 4).
- Στις βασικές στήλες η τιμή z^k - c_k είναι πάντα 0. Στη μη βασική στήλη α_i η τιμή δ_k είναι η τιμή στο ίδιο κουτάκι με τον $\frac{y_{3i}^B}{y_{31}^B}$ της γραμμής α₁ και κάτω από την α_i του tableau 2 πολλαπλασιάζουμε με την τιμή z¹ - c₁ του tableau 1, δηλ. $(z^i - c^i) - \frac{y_{3i}^B}{y_{31}^B} (z^1 - c^1)$
tableau 1

Παράκλιση: συνεχίστε την μέθοδο Simplex:

Tableau 2

	C	-5	4	0	0	0	
B	x^B	a_1	(a_2)	a_3	a_4	a_5	θ
a_1	-5	6	1	-1	1	0	-
(a_4)	0	6	0	1	-3	1	6
a_5	0	21	0	1	2	0	21
		-30	-5	5	-5	0	z^k
		0	1	-5	0	0	$z^k - c_k$

$j_0 = 4$
 ως προς a_{45}
 $y_4^2 = 1$

$a_4^1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 3 \\ -2 \end{bmatrix}$
 $\underbrace{\begin{bmatrix} 1 \\ 3 \\ -2 \end{bmatrix}}_{y_4^2 = 1}$
 ως προς tableau 1

Στο επόμενο tableau φέρει μορφή $a_{k_0} = a_4$ και καταδεικνύει ότι την $a_{j_0} = a_4$.

$$\theta = \min \left\{ \frac{x_j^B}{y_j^2} : j=1,4,5 \text{ και } y_j^2 > 0 \right\}$$

$$= \min \left\{ \frac{6}{1}, \frac{21}{1} \right\} = 6, \text{ όπου } j_0 = 4$$

(B.10.3)

Tableau 2

Η νέα βάση είναι $B = \{a_1, a_4, a_5\}$ μετατάσσεται με εκφυλισμένη βασική λύση: $w^B = 6e_1 + 6e_4 + 21e_5$.

1ος τρόπος:

$$a_2^1 = \begin{bmatrix} -1 \\ -2 \\ 3 \end{bmatrix} \begin{matrix} i=3 \\ i=4 \\ i=5 \end{matrix} \rightarrow \begin{matrix} i=1 \\ i=4 \\ i=5 \end{matrix} \begin{bmatrix} (-1/1) \\ -2 - 3(-1) \\ 3 - (-2)(-1) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix}$$

$$a_3^1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix} \begin{matrix} i=3 \\ i=4 \\ i=5 \end{matrix} \rightarrow \begin{matrix} i=1 \\ i=4 \\ i=5 \end{matrix} \begin{bmatrix} (1/1) \\ 0 - 3 \cdot 1 \\ 0 - (-2) \cdot 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ -3 \\ 2 \end{bmatrix}$$

→ οι συντελεστές από τη στιγμή που μετατασσάται βάση της της a_4^1

2ος τρόπος

Βρίσκουμε τους συντελεστές των a_2, a_3 ως προς τη νέα βάση $\{a_1, a_4, a_5\}$ λύνοντας το αντίστοιχο γραμμικό σύστημα. Πρώτα παρατηρούμε ότι:

$$\lambda_1 a_1^1 + \lambda_2 a_4^1 + \lambda_3 a_5^1 = \begin{bmatrix} \lambda_1 \\ 3\lambda_1 + \lambda_2 \\ -2\lambda_1 + \lambda_3 \end{bmatrix}$$

Άρα: $\begin{bmatrix} \lambda_1 \\ 3\lambda_1 + \lambda_2 \\ -2\lambda_1 + \lambda_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{bmatrix} \Leftrightarrow \begin{matrix} \lambda_1 = 1 \\ \lambda_2 = -3 \\ \lambda_3 = 2 \end{matrix}$

$\begin{bmatrix} \lambda_1 \\ 3\lambda_1 + \lambda_2 \\ -2\lambda_1 + \lambda_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -1 \\ -2 \\ 3 \end{bmatrix} \Leftrightarrow \begin{matrix} \lambda_1 = -1 \\ \lambda_2 = 1 \\ \lambda_3 = 1 \end{matrix}$

Tableau 3

	C	-5	4	0	0	0		
B	CB	x^B	a_{1j}	a_{2j}	a_{3j}	a_{4j}	a_{5j}	
a_1	-5	12	1	0	-2	1	0	
a_2	4	6	0	1	-3	1	0	
a_5	0	15	0	0	5	-1	1	
		-36	-5	4	-2	-1	0	z^k
			0	0	-2	-1	0	$z^k - c^k$
			✓	✓	✓	✓	✓	

Tableau 3

(B10,4)

$$a_2^2 = \begin{bmatrix} -1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix}$$

οδηγός:
 $\frac{y_2^2}{j_2} = 1$

$$a_3 = \begin{bmatrix} 1 & i=1 \\ -3 & (i=4) \\ 2 & i=5 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} i=1 & 1 - (-1)(-3) \\ i=2 & -3/1 \\ i=5 & 2 - 1(-3) \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -2 \\ -3 \\ 5 \end{bmatrix}$$

$$a_4 = \begin{bmatrix} 0 & i=1 \\ 1 & (i=4) \\ 0 & i=5 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} i=1 & 0 - (-1)1 \\ i=2 & 1/1 \\ i=5 & 0 - 1 \cdot 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ -1 \end{bmatrix}$$

οπότε η $x^B = (12, 4, 0, 0, 15)$ είναι σημείο άκρων ελαχίστου της f στο S .

Επειδή επικρατεί "αυτοακεφαλαίως" σε κάθε tableau μπορούμε να κρατάμε σε κάθε στάδιο τις στήλες που δεν είναι βασικές π.χ. στο tableau 3 τις a_3 και a_4 .

M-μέθοδος

Ένα γραμμικό πρόβλημα είναι η εύρεση μιας αρχικής μη εκφυλισμένης βασικής λύσης όταν αυτή δεν είναι προφανής. Η M-μέθοδος βασίζεται στις ακόλουθες ενέργειες:

- α) προσθέτουμε επιπλέον μεταβλητές έτσι ώστε να εμφανιστούν οι βήθες του μη μη μοναδιαίου στον πίνακα A που περιγράφει τον ισοζυκτικό περιορισμό.
- β) για κάθε νέα μεταβλητή x_i προσθέτουμε στην f συνάρτη M· x_i δηλ. $C_i = M$, όπου $M > 0$ μία παράμετρος που πρέπει να είναι μεγαλύτερη ίση από μια τιμή $M_0 > 0$ που θα καθορισθεί κατά τη διαδικασία.

ΑΣ δώμε τα σημειώνων τα παραπάνω σε ένα συγκεκριμένο παράδειγμα.

ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑ: Έστω ότι έχουμε το ακόλουθο π.γ.π. :

$\min (-2x_1 + 3x_2 - x_3 - 2x_4)$

$C = (-2, 3, -3, -2)$

$x_1 + 2x_2 + x_3 + 2x_4 = 8$

$x_2 + x_3 + x_4 = 6$

$2x_3 - 3x_4 = 3$

$x_i \geq 0 \text{ για } i=1,2,3,4$

$A = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 & 2 \\ 0 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 2 & -3 \end{bmatrix} \in \mathbb{R}^{3 \times 4}$

$\underbrace{\quad}_a1 \quad \underbrace{\quad}_a2 \quad \underbrace{\quad}_a3 \quad \underbrace{\quad}_a4$

$b = \begin{bmatrix} 8 \\ 6 \\ 3 \end{bmatrix} \geq 0 \in \mathbb{R}^3 \quad m=3, n=4$

Έχουμε: $\text{rank}(A) = 3$, έπειδή οι 3 πρώτες στήλες είναι γραμ. ανεξάρτητες.

(B.10.6)

Παρατηρούμε ότι στον πίνακα A εμφανίζονται μόνο η 1^η στήλη του μοναδιαίου 3×3 (βλ. στήλη 1).

Επειδή δεν είναι προφανής μία μη εκφυλισμένη βασική λύση, εφαρμόζουμε τη M -μέθοδο, και προσθέτουμε μεταβλητές x_5, x_6 στο 2^ο και 3^ο ισόσημο περιορισμό ώστε ο νέος πίνακας A να έχει στις στήλες του τις στήλες του 3×3 μοναδιαίου πίνακα, δηλ.

$$x_1 + 2x_2 + x_3 + 2x_4 = 8$$

$$x_2 + x_3 + x_4 + x_5 = 6$$

$$2x_3 - 3x_4 + x_6 = 3$$

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 2 & 1 & 2 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 & 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 2 & -3 & 0 & 1 \end{bmatrix} \in \mathbb{R}^{3 \times 6}$$

επιπλέον:

$$\underbrace{f(x)}_z := f(x) + Mx_5 + Mx_6 = \underbrace{-2}_{c_1}x_1 + \underbrace{3}_{c_2}x_2 - \underbrace{3}_{c_3}x_3 - \underbrace{2}_{c_4}x_4 + \underbrace{M}_{c_5}x_5 + \underbrace{M}_{c_6}x_6, \quad M \gg 0.$$

Στη συνέχεια θα λύσουμε το παραπάνω πρόβλημα με τη μέθοδο Simplex προσδιορίζοντας $M_0 > 0$ τ.ω. ότι κάπως να ισχύει για κάθε $M \geq M_0$. Αν καταλήξουμε σε μία βέλτιστη βασική εφικτή λύση με βασικές μεταβλητές που δεν συμπεριλαμβάνουν στις x_5, x_6 τότε έχουμε μία βέλτιστη βασική εφικτή λύση του αρχικού προβλήματος. Διαφορετικά συμπεραίνουμε ότι το αρχικό πρόβλημα δεν έχει λύση.

		C	3	-3	-2	
B	C _B	x _B	a ₂	a ₃	a ₄	θ
a ₁	-2	8	2	1	2	8
a ₅	M	6	1	1	1	6
a ₆	M	3	0	2	-3	3/2
		9M-16	M-4	3M-2	-2M-4	Z ^k
			M-7	3M+1	-2M-2	Z ^k -C _k

Tableau 1

$x^B = (8, 0, 0, 0, 6, 3)$
 $Z^2-C_2 = M-7$, $Z^3-C_3 = 3M+1$, $Z^4-C_4 = -2M-2$. Επομένως, $M > 8$ για να είναι όλα > 0.

Επειδή: $3M+1 > M-7 \Rightarrow M > -8$, επιλέγουμε $k=2$ (in) και $\theta = \min\{8, 6, 3\} = 3$.
 Επομένως, με εκκίνηση από τη μεγαλύτερη θετική τιμή.

		C	+3	-M	-2	
B	C _B	x _B	a ₂	a ₃	a ₄	θ
a ₁	-2	13/2	2	-1/2	7/2	13/7
a ₅	M	9/2	1	-1/2	5/2	9/5
a ₃	-3	3/2	0	-1/2	-3/2	-
		9M-39	M-4	-11M/2	5/2(M-1)	Z ^k
			M-7	-3M-1/2	5/2(M-1)	Z ^k -C _k

$\theta = \min\{13/2, 9/2\} = 9/2$ και $y_j > 0 \Rightarrow j=5$ (out).
 Επομένως φέρνει η a₅ και μπαίνει η a₃ στη βάση.
 Η νέα βασική επιλογή είναι: $W^B = x^B - \frac{3}{2}y^3 + \frac{3}{2}e_3$
 $= 8e_1 + 6e_2 + 3e_3 - \frac{3}{2}(e_1 + e_2 + 2e_3) + \frac{3}{2}e_3 = \frac{3}{2}e_1 + \frac{3}{2}e_2 + \frac{3}{2}e_3$

		C	3	M	M	
B	C _B	x _B	a ₂	a ₃	a ₄	θ
a ₁	-2	1/5	3/5	-1/5	-7/5	
a ₄	-2	9/5	2/5	-1/5	9/5	
a ₃	-3	21/5	3/5	7/5	3/5	
		-83/5	-19/5	-3/5	1/5	Z ^k
			-19/5-3	-3/5-M	1/5-M	Z ^k -C _k

Tableau 2

$$\begin{bmatrix} 1 & 2 \\ 1 & 1 \\ 2 & 1 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 2-0 \cdot 1 & 2 \\ 1-0 \cdot 1 & 1 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}$$

$$\begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ 1 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 0-1/2 \cdot 1 & -1/2 \\ 0-1/2 \cdot 1 & -1/2 \\ 1/2 & 1/2 \end{bmatrix}$$

$$\begin{bmatrix} 2 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 2+3/2 \cdot 1 & 7/2 \\ 1+3/2 \cdot 1 & 5/2 \\ -3/2 & -3/2 \end{bmatrix}$$

Έτσι: $x^B = (1/5, 0, 21/5, 9/5, 0, 0)$ είναι σημείο ολικού ελαχίστου της f, καθώς όλες οι τιμές ανεξαρτημένες x_5^B, x_6^B είναι μηδενικές.

Εχοντας $M \geq 8$, έχουμε: $Z^3-C_3 = M-7 > 0$, $Z^6-C_6 = -3M-1/2 < 0$, $Z^4-C_4 = 5/2M-1/2 > 0$. Επειδή $5/2M-1/2 > M-7 \Rightarrow 3/2M > -13/2$, διαλέγουμε: $k=4$ (in). Έτσι: $\theta = \min\{13/2, 9/2\} = 9/2$. Έτσι $j_0=5$ (out).

$$W^B = x^B - \frac{9}{2}y^5 + \frac{9}{2}e_5 = \frac{13}{2}e_1 + \frac{9}{2}e_2 + \frac{3}{2}e_3 - \frac{9}{2}(\frac{7}{2}e_1 + \frac{5}{2}e_2 - \frac{3}{2}e_3) + \frac{9}{2}e_5$$

$$= \frac{9}{2}e_1 + \frac{15}{10}e_2 + \frac{27}{10}e_3 + \frac{65}{10}e_4 - \frac{63}{10}e_5 = \frac{9}{2}e_1 + \frac{3}{2}e_2 + \frac{27}{10}e_3 + \frac{1}{2}e_4$$

Οόδος για $y_5^4 = 5/2$

Tableau 3

$$a_4 = \begin{bmatrix} 7/2 \\ 5/2 \\ -3/2 \end{bmatrix}, \quad a_2 = \begin{bmatrix} 2 \\ 1 \\ 0 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 2-2/5 \cdot 7/2 & 3/5 \\ 2/5 & 2/5 \\ 0+2/5 \cdot 2/2 & 3/5 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2/5 & 2/5 \\ 2/5 & 2/5 \\ 3/5 & 3/5 \end{bmatrix}$$

$$a_5 = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 0-2/5 \cdot 7/2 & -7/5 \\ 2/5 & 2/5 \\ 0+2/5 \cdot 3/2 & 3/5 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -7/5 & -7/5 \\ 2/5 & 2/5 \\ 3/5 & 3/5 \end{bmatrix}$$

$$a_6 = \begin{bmatrix} -1/2 \\ -1/2 \\ 1/2 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} -1/2-7/2(-1/5) & 7/10-9/10 \\ -1/5 & -1/5 \\ 1/2-(-1/2)(-3/2) & 2/10-3/10 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2/10 & -2/10 \\ -1/5 & -1/5 \\ 2/10 & -1/10 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1/5 & -1/5 \\ -1/5 & -1/5 \\ 1/5 & -1/5 \end{bmatrix}$$