

# Επιχειρησιακή Έρευνα

## Ενότητα 3

### Η μέθοδος Simplex

Αθανασία Μάνου

Διαπανεπιστημιακό Διατμηματικό  
Μεταπτυχιακό Πρόγραμμα Σπουδών  
Μαθηματικά της Αγοράς και της Παραγωγής (ΜΑΠ)

# Τυπική μορφή π.γ.π.

- Είναι:

$$\begin{array}{rcll}
 \max & c_1x_1 & + & c_2x_2 & + & \cdots & + & c_nx_n & & \\
 \text{υπό} & a_{11}x_1 & + & a_{12}x_2 & + & \cdots & + & a_{1n}x_n & \leq & b_1 \\
 & a_{21}x_1 & + & a_{22}x_2 & + & \cdots & + & a_{2n}x_n & \leq & b_2 \\
 & & & & & & & \vdots & & \\
 & a_{m1}x_1 & + & a_{m2}x_2 & + & \cdots & + & a_{mn}x_n & \leq & b_m \\
 & x_1, x_2, \dots, x_n & \geq & 0. & & & & & & 
 \end{array}$$

- Μεγιστοποίηση της αντικειμενικής,
- Όλοι οι περιορισμοί τύπου  $\leq$ ,
- Όλες οι μεταβλητές  $\geq 0$ .

# Τροπή π.γ.π. σε τυπική μορφή I

- Αν πρόκειται για πρόβλημα ελαχιστοποίησης τότε αντί για

$$\min \zeta = c_1x_1 + c_2x_2 + \cdots + c_nx_n$$

θέτουμε

$$- \max -\zeta = -c_1x_1 - c_2x_2 - \cdots - c_nx_n.$$

- Αν κάποιος περιορισμός είναι τύπου

$$a_1x_1 + a_2x_2 + \cdots + a_nx_n \geq b$$

τότε πολλαπλασιάζουμε με  $-1$ , οπότε αντικαθιστούμε με

$$-a_1x_1 - a_2x_2 - \cdots - a_nx_n \leq -b$$

# Τροπή π.γ.π. σε τυπική μορφή II

- Αν κάποιος περιορισμός είναι τύπου

$$a_1x_1 + a_2x_2 + \cdots + a_nx_n = b$$

τότε τον αντικαθιστούμε με δυο περιορισμούς

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

και

$$-a_1x_1 - a_2x_2 - \cdots - a_nx_n \leq -b.$$

# Τροπή π.γ.π. σε τυπική μορφή III

- Αν κάποια μεταβλητή είναι τύπου

$$x_j \leq 0$$

τότε την αντικαθιστούμε με την αντίθετή της, δηλαδή θέτουμε  $x_j = -x'_j$  και έχουμε

$$x'_j \geq 0.$$

- Αν κάποια μεταβλητή είναι τύπου

$$x_j \in \mathbb{R} \text{ (χωρίς περιορισμό)}$$

τότε την αντικαθιστούμε με τη διαφορά δυο μη αρνητικών μεταβλητών, δηλαδή θέτουμε  $x_j = x'_j - x''_j$  και έχουμε

$$x'_j, x''_j \geq 0.$$

# Παράδειγμα

- Να τεθεί σε τυπική μορφή το π.γ.π.

$$\min x_1 - 2x_2 + 4x_3$$

$$\text{υπό } x_1 - 3x_2 \leq 10$$

$$x_1 - x_2 - 2x_3 \geq 3$$

$$x_1 - x_3 = 2$$

$$x_1 \geq 0, x_2 \leq 0, x_3 \in \mathbb{R}.$$

# Παράδειγμα

- Να τεθεί σε τυπική μορφή το π.γ.π.

$$\begin{aligned} \min \quad & x_1 - 2x_2 + 4x_3 \\ \text{υπό} \quad & x_1 - 3x_2 \leq 10 \\ & x_1 - x_2 - 2x_3 \geq 3 \\ & x_1 - x_3 = 2 \\ & x_1 \geq 0, x_2 \leq 0, x_3 \in \mathbb{R}. \end{aligned}$$

- Θέτουμε  $x_2 = -x'_2$  και  $x_3 = x'_3 - x''_3$  με  $x'_2, x'_3, x''_3 \geq 0$ .  
Έχουμε:

$$\begin{aligned} \min \quad & x_1 + 2x'_2 + 4x'_3 - 4x''_3 \\ \text{υπό} \quad & x_1 + 3x'_2 \leq 10 \\ & x_1 + x'_2 - 2x'_3 + 2x''_3 \geq 3 \\ & x_1 - x'_3 + x''_3 = 2 \\ & x_1, x'_2, x'_3, x''_3 \geq 0. \end{aligned}$$

# Παράδειγμα (συνέχεια)

- Έχουμε:

$$\begin{array}{rcll}
 \min & x_1 & + & 2x'_2 & + & 4x'_3 & - & 4x''_3 & & \\
 \text{υπό} & x_1 & + & 3x'_2 & & & & & & \leq & 10 \\
 & x_1 & + & x'_2 & - & 2x'_3 & + & 2x''_3 & & \geq & 3 \\
 & x_1 & & & - & x'_3 & + & x''_3 & & = & 2 \\
 & & & x_1 x'_2, x'_3, x''_3 & & & & & & \geq & 0.
 \end{array}$$

- Πολλαπλασιάζουμε την αντικειμενική και τον 2ο περιορισμό με  $-1$  και αντικαθιστούμε τον 3ο περιορισμό με δυο νέους περιορισμούς:



## Παράδειγμα (συνέχεια)

- Από

$$\begin{array}{l}
 \min \quad x_1 + 2x'_2 + 4x'_3 - 4x''_3 \\
 \text{υπό} \quad x_1 + 3x'_2 \leq 10 \\
 \quad \quad x_1 + x'_2 - 2x'_3 + 2x''_3 \geq 3 \\
 \quad \quad x_1 - x'_3 + x''_3 = 2 \\
 \quad \quad x_1 x'_2, x'_3, x''_3 \geq 0
 \end{array}$$

- γίνεται

$$\begin{array}{l}
 - \max \quad -x_1 - 2x'_2 - 4x'_3 + 4x''_3 \\
 \text{υπό} \quad x_1 + 3x'_2 \leq 10 \\
 \quad \quad -x_1 - x'_2 + 2x'_3 - 2x''_3 \leq -3 \\
 \quad \quad x_1 - x'_3 + x''_3 \leq 2 \\
 \quad \quad -x_1 + x'_3 - x''_3 \leq -2 \\
 \quad \quad x_1 x'_2, x'_3, x''_3 \geq 0.
 \end{array}$$

# Από την τυπική μορφή στη μορφή Simplex

- Για να εφαρμοστεί ο αλγόριθμος επίλυσης Simplex τρέπουμε τους περιορισμούς σε εξισωτικούς προσθέτοντας περιθώριες μεταβλητές:

$$a_{i1}x_1 + a_{i2}x_2 + \cdots + a_{in}x_n \leq b_i$$

↓

$$a_{i1}x_1 + a_{i2}x_2 + \cdots + a_{in}x_n + w_i = b_i$$

$$w_i \geq 0.$$

- Κατόπιν λύνουμε ως προς τις περιθώριες τους νέους περιορισμούς:

$$w_i = b_i - a_{i1}x_1 - a_{i2}x_2 - \cdots - a_{in}x_n.$$

- Το προκύπτον σχήμα αναφέρεται ως λεξικό.

# Παράδειγμα

- Να τεθεί το π.γ.π. σε μορφή λεξικού Simplex:

$$\begin{array}{rcll} \max & 5x_1 & - & 4x_2 \\ \text{υπό} & x_1 & - & x_2 \leq 6 \\ & 3x_1 & - & 2x_2 \leq 24 \\ & -2x_1 & + & 3x_2 \leq 9 \\ & x_1, x_2 & \geq & 0. \end{array}$$

# Παράδειγμα

- Να τεθεί το π.γ.π. σε μορφή λεξικού Simplex:

$$\begin{array}{rcl}
 \max & 5x_1 & - 4x_2 \\
 \text{υπό} & x_1 & - x_2 \leq 6 \\
 & 3x_1 & - 2x_2 \leq 24 \\
 & -2x_1 & + 3x_2 \leq 9 \\
 & x_1, x_2 & \geq 0.
 \end{array}$$

- Έχουμε το λεξικό:

$$\begin{array}{rcl}
 \max & \zeta & = 0 + 5x_1 - 4x_2 \\
 \text{υπό} & w_1 & = 6 - x_1 + x_2 \\
 & w_2 & = 24 - 3x_1 + 2x_2 \\
 & w_3 & = 9 + 2x_1 - 3x_2 \\
 & x_1, x_2, w_1, w_2, w_3 & \geq 0.
 \end{array}$$

# Παράδειγμα (συνέχεια)

- Το λεξικό

$$\begin{array}{rcl}
 \max & \zeta & = 0 + 5x_1 - 4x_2 \\
 \text{υπό} & w_1 & = 6 - x_1 + x_2 \\
 & w_2 & = 24 - 3x_1 + 2x_2 \\
 & w_3 & = 9 + 2x_1 - 3x_2 \\
 & & x_1, x_2, w_1, w_2, w_3 \geq 0.
 \end{array}$$

το γράφουμε συνήθως σε απλοποιημένη μορφή, παραλείποντας το max και τους περιορισμούς μη-αρνητικότητας των μεταβλητών:

$$\begin{array}{rcl}
 \zeta & = & 0 + 5x_1 - 4x_2 \\
 \hline
 w_1 & = & 6 - x_1 + x_2 \\
 w_2 & = & 24 - 3x_1 + 2x_2 \\
 w_3 & = & 9 + 2x_1 - 3x_2
 \end{array}$$

# Λεξικό και ορισμοί I

- Έστω ένα λεξικό, π.χ. το

$$\begin{array}{r} \zeta = 0 + 5x_1 - 4x_2 \\ w_1 = 6 - x_1 + x_2 \\ w_2 = 24 - 3x_1 + 2x_2 \\ w_3 = 9 + 2x_1 - 3x_2 \end{array}$$

- Η ονομασία “λεξικό” παραπέμπει στο ότι μεταφράζει τις μεταβλητές στα αριστερά μέλη με όρους των μεταβλητών στα δεξιά μέλη.
- Το γράμμα  $\zeta$  χρησιμοποιείται για την αντικειμενική συνάρτηση.
- Οι εξαρτημένες μεταβλητές, στα αριστερά, λέγονται βασικές μεταβλητές. Εδώ είναι οι  $w_1, w_2, w_3$  (που ταυτίζονται με τις περιθώριες).

# Λεξικό και ορισμοί II

- Έστω πάλι το λεξικό

$$\begin{array}{r}
 \zeta = 0 + 5x_1 - 4x_2 \\
 \hline
 w_1 = 6 - x_1 + x_2 \\
 w_2 = 24 - 3x_1 + 2x_2 \\
 w_3 = 9 + 2x_1 - 3x_2
 \end{array}$$

- Οι ανεξάρτητες μεταβλητές, στα δεξιά, λέγονται μη-βασικές μεταβλητές. Εδώ είναι οι  $x_1, x_2$  (που ταυτίζονται με τις αρχικές μεταβλητές).
- Θέτοντας τις μη-βασικές μεταβλητές ίσες με 0 παίρνουμε μια λύση του συστήματος των περιορισμών που λέγεται βασική λύση. Εδώ  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (0, 0, 6, 24, 9)$  με τιμή αντικειμενικής συνάρτησης  $\zeta = 0$ .

# Λεξικό και ορισμοί III - Λύσεις I

- Έστω πάλι το λεξικό

$$\begin{array}{r} \zeta = 0 + 5x_1 - 4x_2 \\ \hline w_1 = 6 - x_1 + x_2 \\ w_2 = 24 - 3x_1 + 2x_2 \\ w_3 = 9 + 2x_1 - 3x_2 \end{array}$$

- Λύση = Διάνυσμα που ικανοποιεί τους περιορισμούς που εμφανίζονται στο λεξικό.  
Π.χ. εδώ  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (1, 1, 6, 23, 8)$  με  $\zeta = 1$ .
- Εφικτή λύση = Λύση που ικανοποιεί και τους “κρυφούς” περιορισμούς της μη-αρνητικότητας των μεταβλητών.  
Π.χ.  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (1, 1, 6, 23, 8)$  εφικτή λύση.  
Όμως  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (-1, 0, 7, 27, 7)$  λύση, όχι εφικτή.



# Λεξικό και ορισμοί IV - Λύσεις II

- Έστω πάλι το λεξικό

$$\begin{array}{r} \zeta = 0 + 5x_1 - 4x_2 \\ \hline w_1 = 6 - x_1 + x_2 \\ w_2 = 24 - 3x_1 + 2x_2 \\ w_3 = 9 + 2x_1 - 3x_2 \end{array}$$

- Βασική λύση = Λύση που οι μη-βασ. μεταβλητές είναι 0.  
Π.χ. εδώ  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (0, 0, 6, 24, 9)$  με  $\zeta = 0$ .  
Μπορεί μια λύση να είναι βασική αλλά όχι εφικτή.
- Βασική εφικτή λύση (β.ε.λ.) = Βασική λύση που είναι και εφικτή.
- Βέλτιστη λύση = Εφικτή λύση που μεγιστοποιεί την αντικειμενική συνάρτηση.

# Η ιδέα της μεθόδου Simplex

- Αρχίζουμε από κάποιο λεξικό που μας δίνει β.ε.λ.
- Εξετάζουμε αν η νέα β.ε.λ. είναι βέλτιστη λύση. Αν ναι σταματάμε, αλλιώς ...
- Μετασχηματίζουμε το λεξικό αλλάζοντας τις βασικές μεταβλητές ώστε να πάρουμε νέα β.ε.λ. που βελτιώνει την αντικειμενική συνάρτηση.

# Γιατί λειτουργεί η Simplex;

- Η ιδέα της Simplex λειτουργεί γιατί όπως θα δούμε αργότερα, αν ένα π.γ.π. έχει βέλτιστη λύση τότε έχει αναγκαστικά και βέλτιστη β.ε.λ.
- Οι δυνατές β.ε.λ. είναι πεπερασμένες το πλήθος και άρα αν πηγαίνουμε από β.ε.λ. σε β.ε.λ., βελτιώνοντας την αντικειμενική συνάρτηση θα φθάσουμε σε βέλτιστη λύση σε πεπερασμένο αριθμό βημάτων.

# Βασικά τεχνικά σημεία της Simplex

- Κριτήριο αλλαγής βασικών μεταβλητών για την βελτίωση της αντικειμενικής συνάρτησης από λεξικό σε ισοδύναμο λεξικό.
- Μετασχηματισμός λεξικού σε ισοδύναμο λεξικό, όταν αλλάζουν οι βασικές μεταβλητές.

# Προχωρημένα τεχνικά σημεία της Simplex

- Τι γίνεται όταν έχουμε μη-φραγμένη αντικειμενική συνάρτηση (οπότε δεν υπάρχει βέλτιστη λύση) ;
- Τί γίνεται όταν δεν έχουμε αρχική β.ε.λ. ;
- Τί γίνεται αν κολλήσει η Simplex και κάνει κύκλους μεταξύ κάποιων β.ε.λ. πριν φθάσει σε βέλτιστη β.ε.λ. ;

## Παράδειγμα Simplex - Έναρξη

- Να λυθεί το π.γ.π. :

$$\begin{array}{rcll} \max & 5x_1 & - & 4x_2 \\ \text{υπό} & x_1 & - & x_2 \leq 6 \\ & 3x_1 & - & 2x_2 \leq 24 \\ & -2x_1 & + & 3x_2 \leq 9 \\ & x_1, x_2 & \geq & 0. \end{array}$$

# Παράδειγμα Simplex - Έναρξη

- Να λυθεί το π.γ.π. :

$$\begin{array}{rcll}
 \max & 5x_1 & - & 4x_2 \\
 \text{υπό} & x_1 & - & x_2 \leq 6 \\
 & 3x_1 & - & 2x_2 \leq 24 \\
 & -2x_1 & + & 3x_2 \leq 9 \\
 & x_1, x_2 & \geq & 0.
 \end{array}$$

- Έχουμε το αρχικό λεξικό:

$$\begin{array}{rcll}
 \zeta & = & 0 & + & 5x_1 & - & 4x_2 \\
 \hline
 w_1 & = & 6 & - & x_1 & + & x_2 \\
 w_2 & = & 24 & - & 3x_1 & + & 2x_2 \\
 w_3 & = & 9 & + & 2x_1 & - & 3x_2
 \end{array}$$

με βασική λύση  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (0, 0, 6, 24, 9)$ .

Είναι και εφικτή (β.ε.λ.).

# Παράδειγμα Simplex- 1η επανάληψη

- Παρατηρούμε το αρχικό λεξικό

$$\begin{array}{r} \zeta = 0 + 5x_1 - 4x_2 \\ \hline w_1 = 6 - x_1 + x_2 \\ w_2 = 24 - 3x_1 + 2x_2 \\ w_3 = 9 + 2x_1 - 3x_2 \end{array}$$

(αντιστ. στη β.ε.λ.  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (0, 0, 6, 24, 9)$ ).

- Αν η  $x_1$  αυξηθεί η  $\zeta$  αυξάνει.
- Καθώς η  $x_1$  αυξάνεται οι  $w_1, w_2$  μειώνονται.
- Καθώς η  $x_1$  αυξάνεται η  $w_3$  αυξάνεται.
- Πόσο μπορεί να αυξηθεί η  $x_1$ ;  
Μέχρι κάποια από τις  $w_1, w_2$  να γίνει 0.  
Η  $w_1$  γίνεται 0 για  $x_1 = 6/1$ .  
Η  $w_2$  γίνεται 0 για  $x_1 = 24/3 = 8$ .  
Άρα πρώτα θα γίνει 0 η  $w_1$ .



# Παράδειγμα Simplex - 1η επανάληψη (συνέχεια)

- Επομένως στο αρχικό λεξικό

$$\begin{array}{rclclcl}
 \zeta & = & 0 & + & 5x_1 & - & 4x_2 \\
 \hline
 w_1 & = & 6 & - & x_1 & + & x_2 \\
 w_2 & = & 24 & - & 3x_1 & + & 2x_2 \\
 w_3 & = & 9 & + & 2x_1 & - & 3x_2
 \end{array}$$

- η  $x_1$  γίνεται βασική (αυξάνεται μέχρι  $x_1 = 6$ ),
- η  $w_1$  γίνεται μη-βασική (μειώνεται μέχρι  $w_1 = 0$ ).
- Μετασχηματίζουμε το λεξικό “περνώντας” την  $x_1$  στο αριστερό μέλος, στη θέση της  $w_1$  και εκφράζοντας τις  $w_2, w_3$  συναρτήσει των νέων μη-βασικών μεταβλητών  $w_1, x_2$  (διαδικασία οδήγησης).
- Ο συντελεστής στην τομή της εισερχόμενης και της εξερχόμενης μεταβλητής (εδώ το  $-1$ ) λέγεται οδηγός.

# Παράδειγμα Simplex - 1η επανάληψη (συνέχεια)

- Θεωρούμε το αρχικό λεξικό

$$\begin{array}{rclclcl}
 \zeta & = & 0 & + & 5x_1 & - & 4x_2 \\
 \hline
 w_1 & = & 6 & - & x_1 & + & x_2 \\
 w_2 & = & 24 & - & 3x_1 & + & 2x_2 \\
 w_3 & = & 9 & + & 2x_1 & - & 3x_2
 \end{array}$$

- Απαλείφουμε την μεταβλητή  $x_1$  που μπαίνει στη βάση από την αντικειμενική συνάρτηση και τους περιορισμούς, εκτός του περιορισμού που αφορά τη μεταβλητή  $w_1$  που βγαίνει από τη βάση, εκτελώντας γραμμοπράξεις.
- Για την αντικειμενική συνάρτηση  $\zeta$  έχουμε

$$\zeta + 5 \times w_1 = 0 + 5 \times 6 + (-4 + 5 \times 1)x_2.$$

- Ομοίως για τις  $w_2, w_3$ .
- Τέλος μετακινούμε τη μεταβλητή  $w_1$  που βγαίνει από τη βάση στο δεξιό μέλος.

# Παράδειγμα Simplex - 1η επανάληψη (συνέχεια)

- Το αρχικό λεξικό

$$\begin{array}{r} \zeta = 0 + 5x_1 - 4x_2 \\ \hline w_1 = 6 - x_1 + x_2 \\ w_2 = 24 - 3x_1 + 2x_2 \\ w_3 = 9 + 2x_1 - 3x_2 \end{array}$$

(αντιστ. στη β.ε.λ.  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (0, 0, 6, 24, 9)$ )

- γίνεται

$$\begin{array}{r} \zeta = 30 - 5w_1 + x_2 \\ \hline x_1 = 6 - w_1 + x_2 \\ w_2 = 6 + 3w_1 - x_2 \\ w_3 = 21 - 2w_1 - x_2 \end{array}$$

(αντιστ. στη β.ε.λ.  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (6, 0, 0, 6, 21)$ ).

# Παράδειγμα Simplex - 2η επανάληψη

- Το δεύτερο λεξικό

$$\begin{array}{rcll}
 \zeta & = & 30 & - & 5w_1 & + & x_2 \\
 \hline
 x_1 & = & 6 & - & w_1 & + & x_2 \\
 w_2 & = & 6 & + & 3w_1 & - & x_2 \\
 w_3 & = & 21 & - & 2w_1 & - & x_2
 \end{array}$$

(αντιστ. στη β.ε.λ.  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (6, 0, 0, 6, 21)$ )  
είναι βέλτιστο;

- Όχι, γιατί υπάρχει θετικός συντελεστής μη-βασικής μεταβλητής στην  $\zeta$ , ο συντελεστής της  $x_2$ .
- Καθώς η  $x_2$  αυξάνεται οι  $w_2, w_3$  μειώνονται.
- Η  $x_2$  μπορεί να αυξηθεί μέχρι  $w_2 = 0$  ή  $w_3 = 0$ .  
 Η  $w_2$  γίνεται 0 για  $x_2 = 6/1$ .  
 Η  $w_3$  γίνεται 0 για  $x_2 = 21/1 = 21$ .  
 Άρα πρώτα θα γίνει 0 η  $w_2$ .

# Παράδειγμα Simplex - 2η επανάληψη (συνέχεια)

- Επομένως στο δεύτερο λεξικό

$$\begin{array}{rclclcl}
 \zeta & = & 30 & - & 5w_1 & + & x_2 \\
 \hline
 x_1 & = & 6 & - & w_1 & + & x_2 \\
 w_2 & = & 6 & + & 3w_1 & - & x_2 \\
 w_3 & = & 21 & - & 2w_1 & - & x_2
 \end{array}$$

- η  $x_2$  γίνεται βασική (αυξάνεται μέχρι  $x_2 = 6$ ),
- η  $w_2$  γίνεται μη-βασική (μειώνεται μέχρι  $w_2 = 0$ ).
- Μετασχηματίζουμε το λεξικό “περνώντας” την  $x_2$  στο αριστερό μέλος, στη θέση της  $w_2$  και εκφράζοντας τις  $x_1, w_3$  συναρτήσει των νέων μη-βασικών μεταβλητών  $w_1, w_2$  (διαδικασία οδήγησης).
- Ο οδηγός στην τομή της στήλης της  $x_2$  και της γραμμής της  $w_2$  είναι  $-1$ .

# Παράδειγμα Simplex - 2η επανάληψη (συνέχεια)

- Για το δεύτερο λεξικό έχουμε

$$\begin{array}{r} \zeta = 30 - 5w_1 + x_2 \\ \hline x_1 = 6 - w_1 + x_2 \\ w_2 = 6 + 3w_1 - x_2 \\ w_3 = 21 - 2w_1 - x_2 \end{array}$$

- Απαλείφουμε την μεταβλητή  $x_2$  που μπαίνει στη βάση από την αντικειμενική συνάρτηση και τους περιορισμούς, εκτός του περιορισμού που αφορά τη μεταβλητή  $w_2$  που βγαίνει από τη βάση, εκτελώντας γραμμοπράξεις.
- Τέλος μετακινούμε τη μεταβλητή  $w_2$  που βγαίνει από τη βάση στο δεξιό μέλος.

# Παράδειγμα Simplex - 2η επανάληψη (συνέχεια)

- Το δεύτερο λεξικό

$$\begin{array}{r}
 \zeta = 30 - 5w_1 + x_2 \\
 \hline
 x_1 = 6 - w_1 + x_2 \\
 w_2 = 6 + 3w_1 - x_2 \\
 w_3 = 21 - 2w_1 - x_2
 \end{array}$$

(αντιστ. στη β.ε.λ.  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (6, 0, 0, 6, 21)$ )

- γίνεται

$$\begin{array}{r}
 \zeta = 36 - 2w_1 - w_2 \\
 \hline
 x_1 = 12 + 2w_1 - w_2 \\
 x_2 = 6 + 3w_1 - w_2 \\
 w_3 = 15 - 5w_1 + w_2
 \end{array}$$

(αντ. στη β.ε.λ.  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (12, 6, 0, 0, 15)$ ).

# Παράδειγμα Simplex - 3η επαλάληψη

- Το τρίτο λεξικό

$$\begin{array}{r} \zeta = 36 - 2w_1 - w_2 \\ \hline x_1 = 12 + 2w_1 - w_2 \\ x_2 = 6 + 3w_1 - w_2 \\ w_3 = 15 - 5w_1 + w_2 \end{array}$$

(αντ. στη β.ε.λ.  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (12, 6, 0, 0, 15)$ )  
είναι βέλτιστο;

- Ναι, γιατί όλοι οι συντελεστές μη-βασικών μεταβλητών στην  $\zeta$  είναι μη-θετικοί.
- Επομένως το 36 είναι ένα άνω φράγμα για την τιμή της αντικειμενικής συνάρτησης.
- Αλλά το 36 “πιάνεται” για την  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3) = (12, 6, 0, 0, 15)$ , που αποτελεί επομένως βέλτιστη λύση.



# Διαδικασία οδήγησης - Πράξεις I

- Πως αλλάζουν οι συντελεστές, καθώς κάνουμε οδήγηση από λεξικό σε λεξικό;
- Έστω ένα λεξικό και ας υποθέσουμε ότι έχουμε αποφασίσει ποιά μη-βασική μεταβλητή θα μπει στη βάση και ποιά βασική μεταβλητή θα βγει από τη βάση.
- Συμβολίζουμε:
  - $x_e$ : την εισερχόμενη στη βάση μη-βασική μεταβλητή (entering),
  - $x_n$ : μια οποιαδήποτε άλλη μη-βασική μεταβλητή (non-basic),
  - $x_l$ : την εξερχόμενη από τη βάση βασική μεταβλητή (leaving),
  - $x_b$ : μια οποιαδήποτε άλλη βασική μεταβλητή (basic).

# Διαδικασία οδήγησης - Πράξεις II

- Η γραμμή του οδηγού είναι της μορφής:

$$x_l = bx_n + ax_e + \dots$$

- Οποιαδήποτε άλλη γραμμή είναι της μορφής:

$$x_b = dx_n + cx_e + \dots$$

- Ο οδηγός είναι το  $a$ .
- Η οδήγηση λύνει τη γραμμή του οδηγού ως προς  $x_e$ :

$$x_e = -\frac{b}{a}x_n + \frac{1}{a}x_l + \dots$$

# Διαδικασία οδήγησης - Πράξεις III

- Οπότε για τη γραμμή του οδηγού έχουμε:

$$x_l = bx_n + ax_e + \dots$$

↓

$$x_e = -\frac{b}{a}x_n + \frac{1}{a}x_l + \dots$$

- Για τις άλλες γραμμές, απαλείφεται η  $x_e$ :

$$x_b = dx_n + cx_e + \dots = dx_n + c \left( -\frac{b}{a}x_n + \frac{1}{a}x_l + \dots \right)$$

↓

$$x_b = \left( d - \frac{bc}{a} \right) x_n + \frac{c}{a}x_l + \dots$$

# Διαδικασία οδήγησης - Πράξεις - Σύνοψη

- Σε λεξικό:
  - $a$ : ο οδηγός
  - $b$ : στοιχείο στη γραμμή του οδηγού, εκτός του οδηγού
  - $c$ : στοιχείο στη στήλη του οδηγού, εκτός του οδηγού
  - $d$ : στοιχείο εκτός γραμμής και στήλης του οδηγού
- Μετά την οδήγηση, στο νέο λεξικό οι μετατροπές είναι:

$$\begin{pmatrix} b & a \\ d & c \end{pmatrix} \rightarrow \begin{pmatrix} -\frac{b}{a} & \frac{1}{a} \\ d - \frac{bc}{a} & \frac{c}{a} \end{pmatrix}.$$

# Σύνοψη της βασικής Simplex

- Ξεκινάμε με λεξικό που αντιστοιχεί σε β.ε.λ.
- Αν όλοι οι συντελεστές των μη-βασικών μεταβλητών στην  $\zeta$  είναι μη-θετικοί έχουμε βρει τη βέλτιστη λύση.
- Αν υπάρχουν μη-βασικές μεταβλητές των οποίων οι συντελεστές στην  $\zeta$  είναι θετικοί, διαλέγουμε μία για να μπει στη βάση.
- Από τις βασικές μεταβλητές που μειώνονται καθώς η επιλεγθείσα μη-βασική μεταβλητή αυξάνεται διαλέγουμε την πρώτη που θα μηδενιστεί για να βγει από τη βάση.
- Μετασχηματίζουμε το λεξικό ώστε η αντικειμενική συνάρτηση και οι βασικές μεταβλητές να εκφράζονται συναρτήσει των νέων μη-βασικών μεταβλητών.
- Η τιμή της αντικειμενικής συνάρτησης για τη νέα β.ε.λ. θα είναι μεγαλύτερη ή ίση από την προηγούμενη β.ε.λ.

# Πιθανά προβλήματα

- Απουσία αρχικής β.ε.λ.
- Πολλές επιλογές για εισερχόμενη στη βάση μεταβλητή.
- Απουσία επιλογής για εξερχόμενη από τη βάση μεταβλητή.
- Πολλές επιλογές για εξερχόμενη από τη βάση μεταβλητή.
- Η αντικειμενική συνάρτηση δεν βελτιώνεται στο επόμενο λεξικό.

# Πρόβλημα I: Απουσία αρχικής β.ε.λ.

- Ξεκινάμε με λεξικό που αντιστοιχεί σε β.ε.λ.
- Τί κάνουμε αν δεν έχουμε τέτοιο αρχικό λεξικό;
- Χρησιμοποιούμε ένα βοηθητικό πρόβλημα που μας δίνει αρχική β.ε.λ. ή μας δείχνει ότι το π.γ.π. δεν έχει εφικτές λύσεις.
- Η διαδικασία αυτή αναφέρεται ως φάση I της Simplex: Από βασική λύση σε β.ε.λ.
- Η κλασική διαδικασία που περιγράψαμε είναι η φάση II: Από β.ε.λ. σε βέλτιστη λύση.

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Θεωρούμε το π.γ.π. σε τυπική μορφή

$$\begin{array}{rcll}
 \max & -3x_1 & + & 4x_2 \\
 \text{υπό} & -4x_1 & - & 2x_2 \leq -8 \\
 & -2x_1 & & \leq -2 \\
 & 3x_1 & + & 2x_2 \leq 10 \\
 & -x_1 & + & 3x_2 \leq 1 \\
 & & & -3x_2 \leq -2 \\
 & & & x_1, x_2 \geq 0
 \end{array}$$

με αρχικό λεξιλό

$$\begin{array}{rcll}
 \zeta & = & 0 & - & 3x_1 & + & 4x_2 \\
 \hline
 w_1 & = & -8 & + & 4x_1 & + & 2x_2 \\
 w_2 & = & -2 & + & 2x_1 & & \\
 w_3 & = & 10 & - & 3x_1 & - & 2x_2 \\
 w_4 & = & 1 & + & x_1 & - & 3x_2 \\
 w_5 & = & -2 & & & + & 3x_2
 \end{array}$$



# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Το λεξιλό

$$\begin{array}{rcl}
 \zeta & = & 0 - 3x_1 + 4x_2 \\
 \hline
 w_1 & = & -8 + 4x_1 + 2x_2 \\
 w_2 & = & -2 + 2x_1 \\
 w_3 & = & 10 - 3x_1 - 2x_2 \\
 w_4 & = & 1 + x_1 - 3x_2 \\
 w_5 & = & -2 \qquad \qquad + 3x_2
 \end{array}$$

αντιστοιχεί στη βασική λύση

$$(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3, w_4, w_5) = (0, 0, -8, -2, 10, 1, -2)$$

που δεν είναι εφικτή.

- Αυτό συμβαίνει διότι το π.γ.π. ήταν σε τυπική μορφή με μερικά από τα δεξιά μέλη των περιορισμών  $< 0$ .

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Για να αντιμετωπίσουμε το πρόβλημα αυτό αφαιρούμε μια νέα μεταβλητή  $x_0$  από κάθε αριστερό μέλος της τυπικής μορφής του αρχικού και
- θεωρούμε για αντικειμενική συνάρτηση την  $-x_0$  (δηλαδή προσπαθούμε να ελαχιστοποιήσουμε την  $x_0$ ).
- Προκύπτει τότε το π.γ.π.

$$\begin{array}{rcllcl}
 \max & -x_0 & & & & \\
 \text{υπό} & -x_0 & -4x_1 & - & 2x_2 & \leq & -8 \\
 & -x_0 & -2x_1 & & & \leq & -2 \\
 & -x_0 & +3x_1 & + & 2x_2 & \leq & 10 \\
 & -x_0 & -x_1 & + & 3x_2 & \leq & 1 \\
 & -x_0 & & - & 3x_2 & \leq & -2 \\
 & & & & x_0, x_1, x_2 & \geq & 0.
 \end{array}$$

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Το π.γ.π.

$$\begin{array}{rcllcl}
 \max & -x_0 & & & & \\
 \text{υπό} & -x_0 & -4x_1 & - & 2x_2 & \leq -8 \\
 & -x_0 & -2x_1 & & & \leq -2 \\
 & -x_0 & +3x_1 & + & 2x_2 & \leq 10 \\
 & -x_0 & -x_1 & + & 3x_2 & \leq 1 \\
 & -x_0 & & - & 3x_2 & \leq -2 \\
 & & & & x_0, x_1, x_2 & \geq 0.
 \end{array}$$

έχει προφανώς εφικτή λύση, αρκεί να πάρουμε  $x_1 = x_2 = 0$  για τις αρχικές μεταβλητές και αρκετά μεγάλη τιμή για την τεχνητή μεταβλητή  $x_0$  (πάνω από 8).

# Πρόβλημα I - Αιτιολόγηση μεθόδου

- Το αρχικό π.γ.π. έχει εφικτή λύση, αν και μόνο αν το τροποποιημένο π.γ.π. έχει βέλτιστη λύση με  $\zeta = -x_0 = 0$ .

- Αποδ:

Αν το αρχικό π.γ.π. έχει εφικτή λύση, τότε παίρνουμε εφικτή λύση του τροποποιημένου, θέτοντας  $x_0 = 0$ .

Αυτή είναι και βέλτιστη αφού  $\zeta = -x_0 \leq 0$ .

Αν το τροποποιημένο π.γ.π. έχει βέλτιστη λύση με  $\zeta = -x_0 = 0$ , τότε αγνοώντας το  $x_0$  έχουμε μια εφικτή λύση του αρχικού.

# Πρόβλημα I - Σύνοψη Θεωρίας

- Αν το αρχικό π.γ.π. τεθεί σε τυπική μορφή που δίνει βασική αλλά όχι εφικτή λύση θεωρούμε το τροποποιημένο π.γ.π. και βρίσκουμε τη βέλτιστη λύση του (Φάση I της Simplex).
- Αν το τροποποιημένο π.γ.π. έχει βέλτιστη λύση με  $x_0 = 0$ , τότε αυτή δίνει β.ε.λ. για το αρχικό π.γ.π. και εφαρμόζουμε την Simplex για να βρούμε τη βέλτιστη λύση του αρχικού (Φάση II της Simplex).
- Αν το τροποποιημένο π.γ.π. δεν έχει βέλτιστη λύση με  $x_0 = 0$ , τότε το αρχικό π.γ.π. δεν έχει εφικτές λύσεις.

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Αρχικό λεξικό τροποποιημένου π.γ.π. όχι εφικτό:

$$\begin{array}{r}
 \zeta = 0 - x_0 \\
 \hline
 w_1 = -8 + x_0 + 4x_1 + 2x_2 \\
 w_2 = -2 + x_0 + 2x_1 \\
 w_3 = 10 + x_0 - 3x_1 - 2x_2 \\
 w_4 = 1 + x_0 + x_1 - 3x_2 \\
 w_5 = -2 + x_0 + 3x_2
 \end{array}$$

- Στη Φάση I της Simplex, στο αρχικό λεξικό απαιτούμε να μπει η τεχνητή μεταβλητή στη βάση στο πρώτο βήμα.
- Απαιτούμε να βγει από τη βάση η πιο αρνητική μεταβλητή, εδώ η  $w_1$ .
- Προκύπτει έτσι β.ε.λ. για το τροποποιημένο π.γ.π. στο επόμενο λεξικό.

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Από το όχι εφικτό λεξικό

$$\begin{array}{r}
 \zeta = 0 - x_0 \\
 \hline
 w_1 = -8 + x_0 + 4x_1 + 2x_2 \\
 w_2 = -2 + x_0 + 2x_1 \\
 w_3 = 10 + x_0 - 3x_1 - 2x_2 \\
 w_4 = 1 + x_0 + x_1 - 3x_2 \\
 w_5 = -2 + x_0 + 3x_2
 \end{array}$$

- πάμε στο εφικτό λεξικό (β.ε.λ.)

$$\begin{array}{r}
 \zeta = -8 - w_1 + 4x_1 + 2x_2 \\
 \hline
 x_0 = 8 + w_1 - 4x_1 - 2x_2 \\
 w_2 = 6 + w_1 - 2x_1 - 2x_2 \\
 w_3 = 18 + w_1 - 7x_1 - 4x_2 \\
 w_4 = 9 + w_1 - 3x_1 - 5x_2 \\
 w_5 = 6 + w_1 - 4x_1 + x_2
 \end{array}$$

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Τώρα στο εφικτό λεξικό του τροποποιημένου π.γ.π. εφαρμόζουμε κανονικά την Simplex για να βελτιστοποιήσουμε την αντικειμενική:

$$\begin{array}{r}
 \zeta = -8 - w_1 + 4x_1 + 2x_2 \\
 \hline
 x_0 = 8 + w_1 - 4x_1 - 2x_2 \\
 w_2 = 6 + w_1 - 2x_1 - 2x_2 \\
 w_3 = 18 + w_1 - 7x_1 - 4x_2 \\
 w_4 = 9 + w_1 - 3x_1 - 5x_2 \\
 w_5 = 6 + w_1 - 4x_1 + x_2
 \end{array}$$

- Εισερχόμενη στη βάση μεταβλητή:  $x_1$  ή  $x_2$ .  
Ας επιλέξουμε την  $x_1$ .
- Εξερχόμενη από τη βάση μεταβλητή:  $w_5$ .
- Εφαρμόζουμε τη συνήθη διαδικασία οδήγησης.



# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Από το λεξικό :

$$\begin{array}{rcllclcl}
 \zeta & = & -8 & - & w_1 & + & 4x_1 & + & 2x_2 \\
 \hline
 x_0 & = & 8 & + & w_1 & - & 4x_1 & - & 2x_2 \\
 w_2 & = & 6 & + & w_1 & - & 2x_1 & - & 2x_2 \\
 w_3 & = & 18 & + & w_1 & - & 7x_1 & - & 4x_2 \\
 w_4 & = & 9 & + & w_1 & - & 3x_1 & - & 5x_2 \\
 w_5 & = & 6 & + & w_1 & - & 4x_1 & + & x_2
 \end{array}$$

- πάμε στο:

$$\begin{array}{rcllclcl}
 \zeta & = & -2 & & & - & w_5 & + & 3x_2 \\
 \hline
 x_0 & = & 2 & & & + & w_5 & - & 3x_2 \\
 w_2 & = & 3 & + & 0.5w_1 & + & 0.5w_5 & - & 2.5x_2 \\
 w_3 & = & 7.5 & - & 0.75w_1 & + & 1.75w_5 & - & 5.75x_2 \\
 w_4 & = & 4.5 & + & 0.25w_1 & + & 0.75w_5 & - & 5.75x_2 \\
 x_1 & = & 1.5 & + & 0.25w_1 & - & 0.25w_5 & + & 0.25x_2
 \end{array}$$

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Από το λεξικό:

$\zeta$	=	-2			-	$w_5$	+	$3x_2$
$x_0$	=	2			+	$w_5$	-	$3x_2$
$w_2$	=	3	+	$0.5w_1$	+	$0.5w_5$	-	$2.5x_2$
$w_3$	=	7.5	-	$0.75w_1$	+	$1.75w_5$	-	$5.75x_2$
$w_4$	=	4.5	+	$0.25w_1$	+	$0.75w_5$	-	$5.75x_2$
$x_1$	=	1.5	+	$0.25w_1$	-	$0.25w_5$	+	$0.25x_2$

- πάμε στο:

$\zeta$	=	0					-	$x_0$
$x_2$	=	$2/3$			+	$1/3w_5$	-	$1/3x_0$
$w_2$	=	$4/3$	+	$1/2w_1$	-	$1/3w_5$	+	$5/6x_0$
$w_3$	=	$11/3$	-	$3/4w_1$	-	$1/6w_5$	+	$23/12x_0$
$w_4$	=	$2/3$	+	$1/4w_1$	-	$7/6w_5$	+	$23/12x_0$
$x_1$	=	$5/3$	+	$1/4w_1$	-	$1/6w_5$	-	$1/12x_0$

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Το λεξικό

$\zeta$	=	0				-	$x_0$	
$x_2$	=	$2/3$		+	$1/3w_5$	-	$1/3x_0$	
$w_2$	=	$4/3$	+	$1/2w_1$	-	$1/3w_5$	+	$5/6x_0$
$w_3$	=	$11/3$	-	$3/4w_1$	-	$1/6w_5$	+	$23/12x_0$
$w_4$	=	$2/3$	+	$1/4w_1$	-	$7/6w_5$	+	$23/12x_0$
$x_1$	=	$5/3$	+	$1/4w_1$	-	$1/6w_5$	-	$1/12x_0$

είναι βέλτιστο για το τροποποιημένο πρόβλημα, οπότε η φάση I της Simplex τελείωσε.

- Αφού η βέλτιστη τιμή της  $\zeta$  είναι 0, το αρχικό πρόβλημα έχει εφικτή λύση, που βρίσκεται παραλείποντας την  $x_0$  από το λεξικό:  $(x_1, x_2, w_1, w_2, w_3, w_4, w_5) = (5/3, 2/3, 0, 4/3, 11/3, 2/3, 0)$ .

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Κρατάμε τους περιορισμούς του λεξικού

$$\begin{array}{rcccccc}
 \zeta & = & 0 & & & - & x_0 \\
 \hline
 x_2 & = & 2/3 & & + & 1/3w_5 & - & 1/3x_0 \\
 w_2 & = & 4/3 & + & 1/2w_1 & - & 1/3w_5 & + & 5/6x_0 \\
 w_3 & = & 11/3 & - & 3/4w_1 & - & 1/6w_5 & + & 23/12x_0 \\
 w_4 & = & 2/3 & + & 1/4w_1 & - & 7/6w_5 & + & 23/12x_0 \\
 x_1 & = & 5/3 & + & 1/4w_1 & - & 1/6w_5 & - & 1/12x_0
 \end{array}$$

παραλείποντας την  $x_0$ .

- Υπολογίζουμε την αντικειμενική συνάρτηση του αρχικού συναρτήσεϊ των μη βασικών μεταβλητών του λεξικού:

$$\begin{aligned}
 \zeta &= -3x_1 + 4x_2 \\
 &= -3(5/3 + 1/4w_1 - 1/6w_5) + 4(2/3 + 1/3w_5) \\
 &= -7/3 - 3/4w_1 + 11/6w_5.
 \end{aligned}$$

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Για τη φάση II ξεκινάμε από το λεξικό

$$\begin{array}{rcll}
 \zeta & = & -7/3 & - & 3/4w_1 & + & 11/6w_5 \\
 \hline
 x_2 & = & 2/3 & & & + & 1/3w_5 \\
 w_2 & = & 4/3 & + & 1/2w_1 & - & 1/3w_5 \\
 w_3 & = & 11/3 & - & 3/4w_1 & - & 1/6w_5 \\
 w_4 & = & 2/3 & + & 1/4w_1 & - & 7/6w_5 \\
 x_1 & = & 5/3 & + & 1/4w_1 & - & 1/6w_5
 \end{array}$$

- και πάμε στο

$$\begin{array}{rcll}
 \zeta & = & -9/7 & - & 5/14w_1 & - & 11/7w_4 \\
 \hline
 x_2 & = & 6/7 & + & 1/14w_1 & - & 2/7w_4 \\
 w_2 & = & 8/7 & + & 3/7w_1 & + & 2/7w_4 \\
 w_3 & = & 25/7 & - & 11/14w_1 & + & 1/7w_4 \\
 w_5 & = & 4/7 & + & 3/14w_1 & - & 6/7w_4 \\
 x_1 & = & 11/7 & + & 3/14w_1 & + & 1/7w_4
 \end{array}$$

# Πρόβλημα I - Παράδειγμα

- Το τελευταίο λεξικό

$$\begin{array}{r}
 \zeta = -9/7 - 5/14w_1 - 11/7w_4 \\
 \hline
 x_2 = 6/7 + 1/14w_1 - 2/7w_4 \\
 w_2 = 8/7 + 3/7w_1 + 2/7w_4 \\
 w_3 = 25/7 - 11/14w_1 + 1/7w_4 \\
 w_5 = 4/7 + 3/14w_1 - 6/7w_4 \\
 x_1 = 11/7 + 3/14w_1 + 1/7w_4
 \end{array}$$

είναι βέλτιστο και δίνει την βέλτιστη β.ε.λ.

$$\begin{aligned}
 (x_1, x_2, w_1, w_2, w_3, w_4, w_5) = \\
 (11/7, 6/7, 0, 8/7, 25/7, 0, 4/7).
 \end{aligned}$$