

01/11/2021

Μάθημα 10

Ενότητα 3: ΘΕΩΡΙΑ ΔΥΙΚΟΤΗΤΑΣ

3.1. Εισαγωγή

Για κάθε π.χ.π. μπορεί να ορισθεί το δυικό του.

Για να οριστεί το δυικό θα δούμε την ημικανονική μορφή.

Ορισμός

Ένα π.χ.π. είναι σε ημικανονική μορφή (HK) αν εκφράζεται με έναν από τους παρακάτω τρόπους:

$$\begin{array}{l} \max c'x \\ \text{υπό } Ax \leq b \\ x \geq 0 \end{array} \quad \text{ή} \quad \begin{array}{l} \min c'x \\ \text{υπό } Ax \geq b \\ x \geq 0 \end{array}$$

όπου $c \in \mathbb{R}^n$, $b \in \mathbb{R}^m$, A πίνακας $m \times n$ και $x \in \mathbb{R}^n$.

Συγκεκριμένα, την πρώτη μορφή την ονομάζουμε ημικανονική μορφή μεγιστοποίησης (HK-max), ενώ τη δεύτερη την ονομάζουμε ημικανονική μορφή ελαχιστοποίησης (HK-min).

Σημείωση:

■ Σε προβλήματα μεγιστοποίησης η προβλεπόμενη φορά των γρ. περιορισμών είναι \leq , ενώ σε προβλήματα ελαχιστοποίησης είναι \geq . Άρα, μπορούμε να πούμε ότι ένα π.χ.π. είναι σε ημικανονική μορφή όταν οι γρ. περιορισμοί έχουν την προβλεπόμενη φορά και οι μεταβλητές απόφασης είναι μη-αρνητικές.

■ Για να προσδιορίσω ένα π.χ.π. σε ημικανονική μορφή χρειάζομαι την τετράδα

$$P = HK(p, A, b, c)$$

όπου $p = \begin{cases} 0, & \text{έχω min} \\ 1, & \text{έχω max} \end{cases}$, A : πίνακας των συντελ. στους γρ. περιορισμούς,
 b : το διάνυσμα των σταθερών όρων στους περιορισμούς,
 c : το διάνυσμα των συντελεστών στην α.σ.

$$\begin{array}{l} \max c'x \\ \text{υπό } Ax \leq b \\ x \geq 0 \end{array}$$

$$\begin{array}{l} \min c'x \\ \text{υπό } Ax \geq b \\ x \geq 0 \end{array}$$

$$\begin{aligned} \max c'x \\ \text{υπό } Ax=b \\ x \geq 0 \end{aligned}$$

■ Αντίστοιχα, ένα π.χ.π. σε κανονική μορφή περιγράφεται ως $P = \text{HK}(A, b, c)$

Παράδειγμα

Να φέρετε σε ΗΚ-max μορφή το

$$\begin{aligned} \min 2x_1 + 5x_2 \\ \text{υπό } 3x_1 + 7x_2 = 6 \\ x_1 - 5x_2 \geq 3 \\ x_1 \leq 0, x_2 \in \mathbb{R} \end{aligned} \quad \begin{cases} x_1 = -x_1' \\ x_1' \geq 0 \\ x_2 = x_2' - x_2'' \\ x_2', x_2'' \geq 0 \end{cases} \quad \begin{aligned} \min -2x_1' + 5x_2' - 5x_2'' \\ \text{υπό } -3x_1' + 7x_2' - 7x_2'' = 6 \\ -x_1' - 5x_2' + 5x_2'' \geq 3 \\ x_1', x_2', x_2'' \geq 0 \end{aligned} \quad \Leftrightarrow$$

$$\begin{aligned} \Leftrightarrow \quad & -\max +2x_1' - 5x_2' + 5x_2'' \\ & \text{υπό } -3x_1' + 7x_2' - 7x_2'' \leq 6 \\ & \quad +3x_1' - 7x_2' + 7x_2'' \leq -6 \\ & \quad x_1' + 5x_2' - 5x_2'' \leq -3 \\ & \quad x_1', x_2', x_2'' \geq 0 \end{aligned}$$

$$A = \begin{bmatrix} -3 & 7 & -7 \\ 3 & -7 & 7 \\ 1 & 5 & -5 \end{bmatrix}, \quad b = \begin{pmatrix} 6 \\ -6 \\ -3 \end{pmatrix}, \quad c = \begin{pmatrix} 2 \\ -5 \\ 5 \end{pmatrix}$$

$$P = \text{HK}(1, A, b, c).$$

3.2. Ορισμός δυϊκού προβλήματος

Θεωρούμε ένα π.χ.π. σε ΗΚ-max $P = \text{HK}(1, A, b, c)$

$$\begin{aligned} Z_p = \max c'x \\ \text{υπό } Ax \leq b \quad (1) \\ x \geq 0 \end{aligned}$$

$$\left(Ax \leq b \Leftrightarrow \begin{pmatrix} a_1' \\ a_2' \\ \vdots \\ a_m' \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} \leq \begin{pmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_m \end{pmatrix} \Leftrightarrow a_i' x \leq b_i, i=1, \dots, m \right)$$

Θέλω να βρω ένα "καλό" άνω φράγμα για την Z_p .

Θεωρώ τη συνάρτηση

$$L(x, w) = \underline{c}'x + w'(b - Ax) =$$

$$= \underline{c}'x + (w_1, w_2, \dots, w_m) \begin{pmatrix} b_1 - a_1'x \\ b_2 - a_2'x \\ \vdots \\ b_m - a_m'x \end{pmatrix} =$$

$$= \underline{c}'x + \sum_{i=1}^m w_i (b_i - a_i'x) =$$

$$= \underline{c}'x - \sum_{i=1}^m w_i (a_i'x - b_i).$$

Τα $w_i > 0 \quad \forall i=1, \dots, m$.

Αυτή ονομάζεται Λαγκρανζιανή συνάρτηση.

- Αν $a_i'x - b_i > 0 \Rightarrow a_i'x > b_i$ για κάποιο $i \in \{1, 2, \dots, m\}$, τότε το x δεν ανήκει στην εφικτή περιοχή του (1).
- Αν x ανήκει στην εφικτή περιοχή του (1), τότε $L(x, w) \geq \underline{c}'x, \forall w \geq 0$.

Η Λαγκρανζιανή συνάρτηση προκύπτει αν από την α.σ. του αρχικού π.χ.π. αφαιρέσουμε τους όρους $w_i(a_i'x - b_i)$ που είναι οι ποινές αν παραβιαστούν οι περιορισμοί $a_i'x \leq b_i$.

Οι ποσότητες $w_i \geq 0$ ονομάζονται ποινές και είναι οι ποινές ανά μονάδα παραβίασης του i -οστού περιορισμού του π.χ.π. (1).

Ορίζουμε ένα νέο πρόβλημα

$$z_L(w) = \max_{x \geq 0} L(x, w) \quad (2)$$

Λήμμα: $z_L(w) \geq z_p, \forall w \geq 0$.

Απόδειξη: $z_L(w) = \max \{L(x, w) : x \geq 0\} \geq$

$$\geq \max \{L(x, w) : x \geq 0, Ax \leq b\}$$

επειδή η επιτρεπτή περιοχή του Z^{ov} είναι υποσύνολο της επιτρεπτής περιοχής του Z^{ov} .

Αν $Ax \leq b$ και $w \geq 0$, τότε

$$L(x, w) = c'x + \underbrace{w'(b - Ax)}_{\geq 0} \geq c'x.$$

$$\text{τότε } \max \{L(x, w) : x \geq 0, Ax \leq b\} \geq \max \{c'x : x \geq 0, Ax \leq b\} = Z_p.$$

Άρα, $Z_L(w) \geq Z_p, \forall w \geq 0$.

Από την παραπάνω απόδειξη φαίνεται ότι η βέλτιστη τιμή του (2) είναι μεγαλύτερη ή ίση από τη βέλτιστη τιμή του (1), διότι:

- Το (2) έχει ~~επιτρεπτή~~ επιτρεπτή περιοχή που είναι υποσύνολο της επιτρεπτής του (1).

- Για τα x που ανήκουν στην επιτρεπτή περιοχή του (1)

$$\text{η } L(x, w) \geq c'x.$$

Έτσι, το (2) ονομάζεται πρόβλημα Lagrangeανής χαλάρωσης του (1).

Για κάθε w το $Z_L(w)$ αποτελεί άνω φράγμα για το Z_p , άρα και το $\inf \{Z_L(w) : w \geq 0\}$ είναι άνω φράγμα για το Z_p .

Ορισμός Το πρόβλημα βελτιστοποίησης

$$Z_D = \inf \{Z_L(w) : w \geq 0, w \in \mathbb{R}^m\} \quad (3)$$

ονομάζεται δύο πρόβλημα (dual problem) του (1).

Θεώρημα (Ασθενές Δύο Θεώρημα)

$$Z_p \leq Z_D$$

Γράφεται το (3) σε πιο απλή μορφή:

$$Z_L(w) = \max_{x \geq 0} L(x, w) = \max_{x \geq 0} c'x + w'(b - Ax) =$$

$$= \max_{x \geq 0} c'x + w'b - w'Ax = w'b + \max_{x \geq 0} (c' - w'A)x$$

$$\underline{w}'A = \underline{w}'(A_1 \ A_2 \ \dots \ A_n) = (\underline{w}'A_1 \ \underline{w}'A_2 \ \dots \ \underline{w}'A_n)$$

$$\text{όπου } (\underline{c}' - \underline{w}'A) \underline{x} = (c_1 - \underline{w}'A_1, c_2 - \underline{w}'A_2, \dots, c_n - \underline{w}'A_n) \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{pmatrix} = \sum_{j=1}^n (c_j - \underline{w}'A_j) x_j$$

$$\text{Άρα } z_L(\underline{w}) = \underline{w}'\underline{b} + \max_{\underline{x} \geq 0} \underbrace{\sum_{j=1}^n (c_j - \underline{w}'A_j) x_j}_{f_L(\underline{w})}$$

$$\text{με } f_L(\underline{w}) = \max_{\underline{x} \geq 0} \sum_{j=1}^n (c_j - \underline{w}'A_j) x_j = \begin{cases} 0, & \text{αν } c_j - \underline{w}'A_j \leq 0 \ \forall j \in \{1, \dots, n\} \\ \infty, & \text{διαφορετικά} \end{cases}$$

$$\text{Ονόζει } z_L(\underline{w}) = \begin{cases} \underline{w}'\underline{b}, & \text{αν } \underline{c}' - \underline{w}'A \leq 0 \\ \infty, & \text{αλλιώς} \end{cases}$$

03/11/2021

Μάθημα 11

$$z_p = \max_{\underline{x}} \underline{c}'\underline{x} \\ \text{υπό } A\underline{x} \leq \underline{b} \quad (1) \quad (P) \\ \underline{x} \geq 0$$

$$L(\underline{x}, \underline{w}) = \underline{c}'\underline{x} + \underline{w}'(\underline{b} - A\underline{x})$$

$$z_L(\underline{w}) = \max_{\underline{x}} L(\underline{x}, \underline{w}) \quad (2) \\ \text{υπό } \underline{x} \geq 0$$

$$\forall \underline{w} \geq 0, \quad z_L(\underline{w}) \geq z_p$$

$$z_D = \inf \{ z_L(\underline{w}) : \underline{w} \geq 0, \underline{w} \in \mathbb{R}^m \} \quad (D) \quad (3)$$

$$z_L(\underline{w}) = \underline{w}'\underline{b} + f_L(\underline{w})$$

$$f_L(\underline{w}) = \begin{cases} 0, & \underline{c}' - \underline{w}'A \leq 0 \\ \infty, & \text{αλλιώς} \end{cases}$$

$$\text{Άρα, } z_L(\underline{w}) = \begin{cases} \underline{w}'\underline{b}, & \text{αν } \underline{c}' - \underline{w}'A \leq 0 \\ \infty, & \text{αλλιώς} \end{cases}$$

Εφόσον το (D) είναι πρόβλημα ελαχιστοποίησης, μπορούμε να περιορίσουμε στα $\underline{w} : \underline{c}' - \underline{w}'A \leq 0$.

$$\begin{aligned} \text{Άρα, } z_D &= \inf \{ z_L(\underline{w}) : \underline{w} \geq 0, \underline{w} \in \mathbb{R}^m \} = \\ &= \inf \{ z_L(\underline{w}) : \underline{w} \geq 0, \underline{c}' - \underline{w}'A \leq 0 \} = \\ &= \inf \{ \underline{w}'\underline{b} : \underline{w} \geq 0, \underline{c}' - \underline{w}'A \leq 0 \}. \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{Άρα, } z_D &= \min \underline{w}'\underline{b} \\ &\text{υπό } \underline{c}' - \underline{w}'A \leq 0 \\ &\quad \underline{w} \geq 0 \end{aligned}$$

$$\underline{w}'\underline{b} \in \mathbb{R} \Rightarrow \underline{w}'\underline{b} = (\underline{w}'\underline{b})' = \underline{b}'\underline{w}$$

$$\begin{aligned} z_D &= \min \underline{b}'\underline{w} \\ &\text{υπό } A'\underline{w} \geq \underline{c} \quad (D) \\ &\quad \underline{w} \geq 0 \end{aligned}$$

Θεώρημα

$$\begin{aligned} \text{Έστω το η.χ.π. } z_P &= \max \underline{c}'\underline{x} \\ &\text{υπό } A\underline{x} \leq \underline{b} \quad (P) \\ &\quad \underline{x} \geq 0 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \text{και το δ.π. του } z_D &= \min \underline{b}'\underline{w} \\ &\text{υπό } A'\underline{w} \geq \underline{c} \quad (D) \\ &\quad \underline{w} \geq 0 \end{aligned}$$

τότε το δ.π. του (D) είναι το (P).

Άρα, μπορούμε να μιλάμε για ζεύγη η.χ.π. που το ένα είναι δ.π. του άλλου.

Απόδειξη:

Για να βρω το δ.π. του (D) πρέπει να το μετατρέψω σε HK-max μορφή.

$$\begin{aligned} z_D &= \min \underline{b}'\underline{w} & z_D &= -\max (-\underline{b})'\underline{w} \\ \text{υπό } A'\underline{w} &\geq \underline{c} & \Leftrightarrow & \text{υπό } (-A)'\underline{w} \leq -\underline{c} \\ \underline{w} &\geq 0 & & \underline{w} \geq 0 \end{aligned}$$

το δυϊκό του (D) είναι:

$$-\min(-c)'x$$

$$\max c'x$$

$$\text{υπό } (-A)'x \geq (-b)'$$

\Leftrightarrow

$$\text{υπό } Ax \leq b$$

είναι πράγματι το (P).

$$x \geq 0$$

$$x \geq 0$$

$$z_p \leq z_D$$

Υπενθύμιση

Προβλεπόμενη φορά στους γραμμικούς περιορισμούς:

$$\max \rightarrow \leq$$

$$\min \rightarrow \geq$$

προβλεπόμενη φορά στους περιορισμούς μη αρνης.

$$x_j \geq 0$$

$$w_i \geq 0$$

Απευθείας εύρεση δυϊκού

<u>P</u>		<u>D</u>
# μετ. απόφασης	\rightarrow	# γραμ. περιορισμών
# γραμ. περιορισμών	\rightarrow	# μετ. απόφασης
max	\rightarrow	min
min	\rightarrow	max
i-οστός γραμ. περιορισμός με προβλεπόμενη φορά	\rightarrow	i-οστή μετ. απόφασης ≥ 0
i-οστός γραμ. περιορισμός με φορά αντίθετη της προβλεπόμενης	\rightarrow	i-οστή μετ. απόφασης ≤ 0
i-οστός γραμ. περιορισμός =	\rightarrow	i-οστή μετ. απόφασης $\in \mathbb{R}$
j-οστή μετ. απόφασης ≥ 0	\rightarrow	j-οστός γραμ. περιορισμός με προβλ. φορά
j-οστή μετ. απόφασης ≤ 0	\rightarrow	j-οστός γραμ. περιορισμός με φορά αντίθετη της προβλ.
j-οστή μετ. απόφασης $\in \mathbb{R}$	\rightarrow	j-οστός γραμ. περιορισμός =

Παράδειγμα

$$\min 5x_1 + 3x_2 + 7x_3$$

$$\text{υπό } x_1 + x_2 - x_3 \leq 8$$

$$2x_1 - 7x_2 + x_3 \geq 9 \quad (P)$$

$$3x_1 + 2x_2 - 7x_3 = 6$$

$$x_1 - x_3 \leq 3$$

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

3 μετ. απόφ.

4 γρ. περιορ.

$$(D) \quad 4 \text{ μετ. απόφ. } w_1, w_2, w_3, w_4$$

3 γρ. περιορισμούς

$$\max 8w_1 + 9w_2 + 6w_3 + 3w_4$$

$$\text{υπό } 1w_1 + 2w_2 + 3w_3 + 1w_4 \leq 5$$

$$1w_1 - 7w_2 + 2w_3 \geq 3$$

$$-1w_1 + 1w_2 - 7w_3 - 1w_4 = -7$$

$$w_1 \leq 0, w_2 \geq 0, w_3 \in \mathbb{R}, w_4 \leq 0$$

3.3 Το Ισχυρό Θεώρημα Διικότητας

$$z_p = \max c'x$$

(P) υπό $Ax \leq b$
 $x \geq 0$

$$z_D = \min b'w$$

(D) υπό $A'w \geq c$
 $w \geq 0$

Λήμμα: Αν x και w επίλυσις λύσεις των (P) και (D), αντίστοιχα ($x \in F_P, w \in F_D$), τότε

$$c'x \leq z_p \leq z_D \leq b'w$$

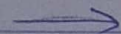
Λήμμα: Αν $x^* \in F_P, w^* \in F_D$ και $c'x^* = b'w^*$, τότε η x^* είναι βέλτιστη λύση του (P) και η w^* είναι βέλτιστη λύση του (D).

Απόδειξη:

$$w^* \in F_D \Rightarrow c'x \leq b'w^*, \forall x \in F_P$$

$$\xrightarrow{b'w^* = c'x^*} c'x \leq c'x^*, \forall x \in F_P$$

$$\Rightarrow x^* \text{ βέλτιστη λύση του (P)}$$



$$\begin{aligned}
 x^* \in F_P &\Rightarrow c'x^* \leq b'w, \forall w \in F_D \\
 &\Rightarrow b'w^* \leq b'w, \forall w \in F_D \\
 &\Rightarrow w^* \text{ βέλτιστη λύση του (D)}
 \end{aligned}$$

Θεώρημα (Ισχυρό Θεώρημα Δuality)

Αν ένα π.γ.π. έχει βέλτιστη λύση, τότε και το δυικό του έχει βέλτιστη λύση και οι τιμές των αντικειμενικών συναρτήσεων στις βέλτιστες λύσεις ταυτίζονται.

Απόδειξη:

Έστω ότι το πρωτεϊόν έχει βέλτιστη λύση x και B ο αντίστοιχος βασικός πίνακας. Θα ισχύει $x_B = B^{-1}b$ και από το κριτήριο βελτιστότητας $\bar{c}_j \leq 0, \forall j \in \{1, 2, \dots, n\}$ με $\bar{c}_j = c_j - c'_B B^{-1}A_j$.

Τα παραπάνω ισχύουν αν έχουμε το (P) σε κανονική μορφή

$$\begin{aligned}
 z_P &= \max c'x \\
 \text{υπό } Ax &= b \\
 x &\geq 0
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 \text{Το δυικό του θα είναι } z_D &= \min b'w \\
 \text{υπό } A'w &\geq c \\
 w &\in \mathbb{R}^m
 \end{aligned}$$

Έστω $w' = c'_B B^{-1}$, τότε

$$c_j - w'A_j = c_j - c'_B B^{-1}A_j = \bar{c}_j \leq 0 \quad \forall j \in \{1, \dots, n\}$$

$$\begin{aligned}
 \text{και, άρα, } c' - w'A &\leq 0 \Rightarrow -w'A \leq -c' \Rightarrow w'A \leq c' \Rightarrow A'w \geq c \\
 &\Rightarrow w \in F_D.
 \end{aligned}$$

Επίσης, έχουμε

$$\begin{aligned}
 b'w \in \mathbb{R} &\Rightarrow b'w = w'b = c'_B B^{-1}b = c'_B x_B = c'x. \\
 b'w = (b'w)' &= w'b
 \end{aligned}$$

Άρα, w βέλτιστη λύση του (D).

Πόρισμα

Αν ένα από τα (P) και (D) είναι μη-φραγμένο, τότε το άλλο είναι μη-εφικτό.

Απόδειξη

Έστω το (P) που είναι σε HK-max μορφή είναι μη-φραγμένο, δηλαδή $z_p = \infty$. Έστω ότι το (D) έχει εφικτή λύση w , τότε $z_p \leq z_D \leq \underbrace{b'w}_{\text{πεπερασμένο}}$, άτοπο.

Άρα, το (D) μη-εφικτό. ■

Σημείωση

Αν ένα π.χ.π. είναι μη-εφικτό, τότε το δυϊκό του μπορεί να είναι μη-εφικτό ή μη-φραγμένο.

$P \backslash D$	μη-εφικτό	βέλτισση	μη-φραγμένο
μη-εφικτό	✓	×	✓
βέλτ. λύση	×	✓	×
μη-φραγμένο	✓	×	×