

数理計画法

第4回: 単体法の実践

数理計画法

第4回:単体法の実践

今日の授業予定

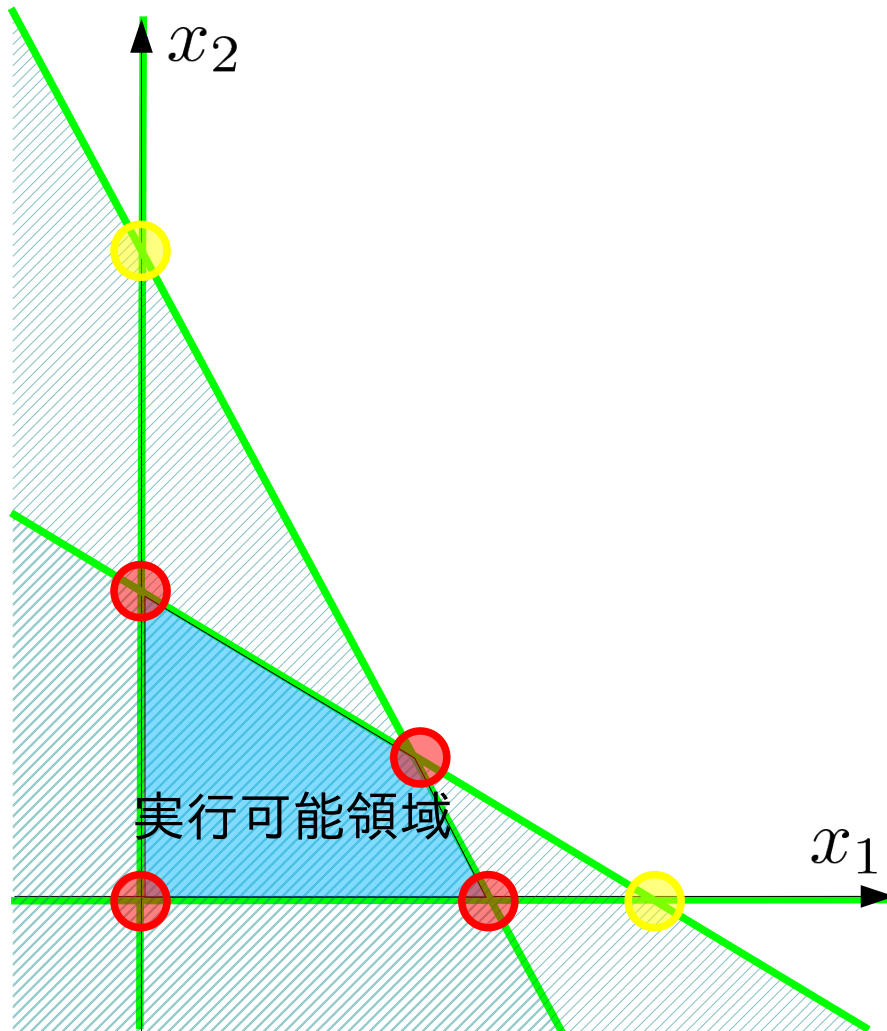
前回授業内容の復習

演習問題3の解説

演習問題4の実践

前回授業内容の復習

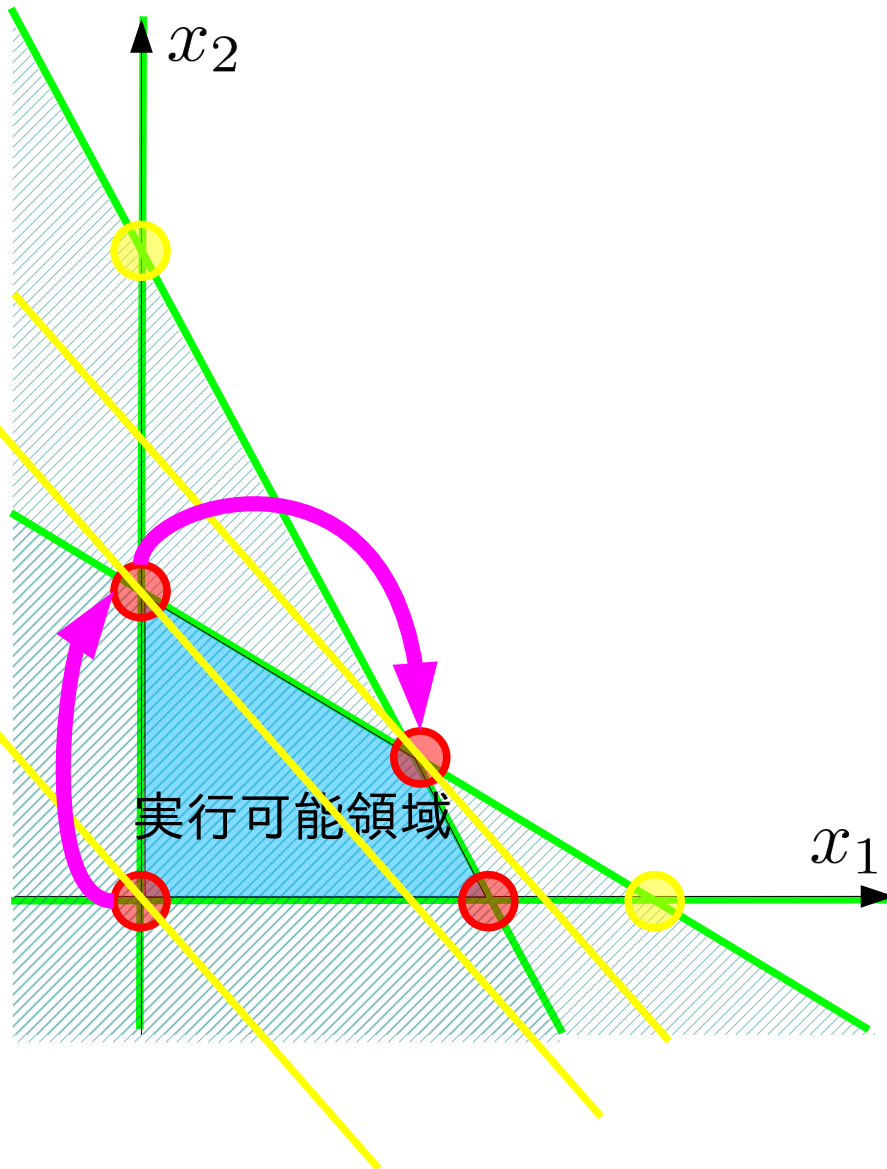
等式標準形の総当たり解法の問題点



- 全ての交点を求める際に unnecessary 連立方程式も解く必要がある
- 最適解は実行可能領域の端点に存在する
- 実行可能領域の端点だけを求めれば十分

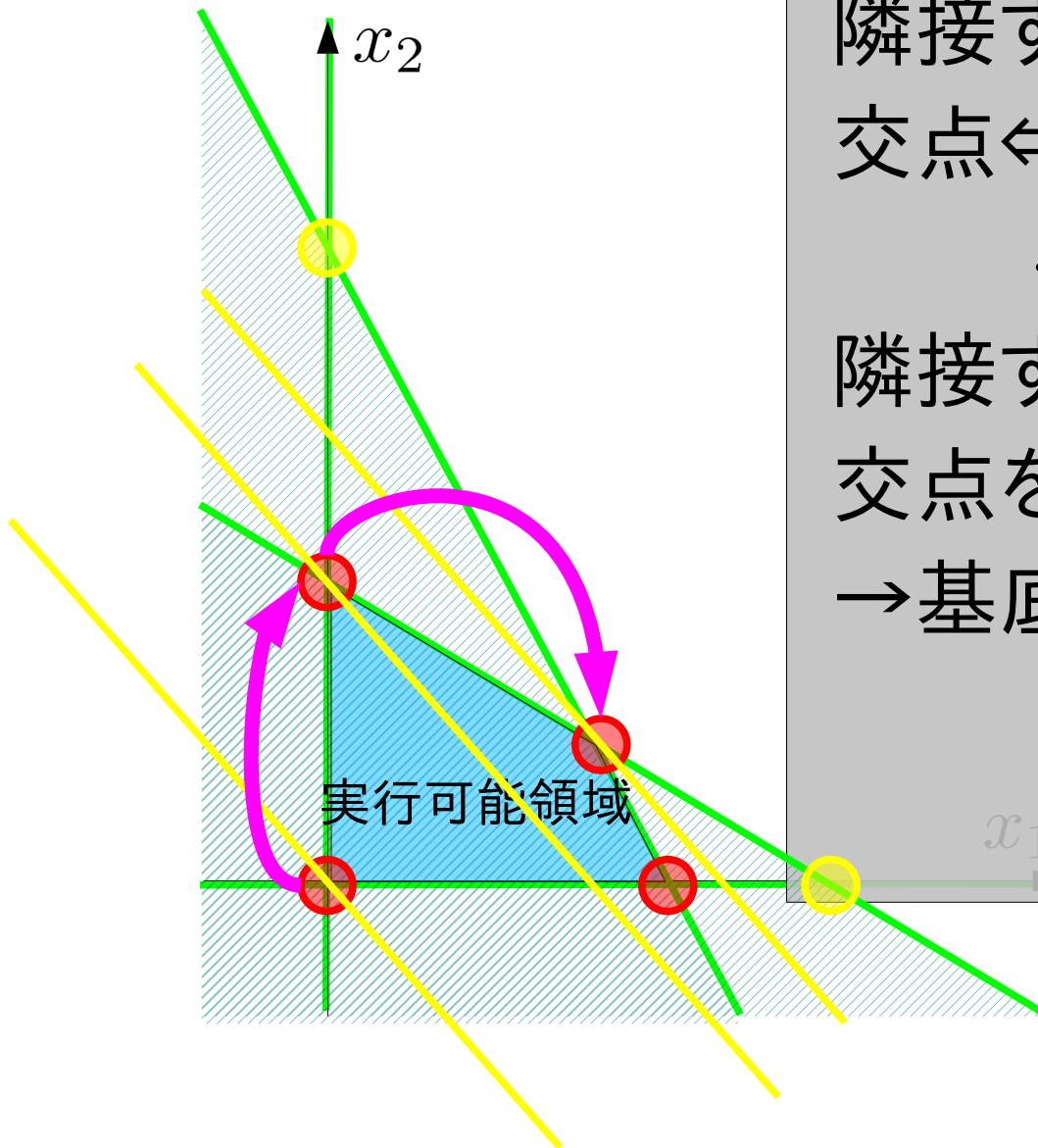
※実行可能解の端点だけを調べて最適解を探す方法→**単体法**

単体法的基本的なアイデア



- 実行可能領域の端点のうち、一つがあらかじめ分かっているものとし、これを最初の交点とする
- 隣接する端点のうち、目的関数を改善するものを選び、交点を更新する
- 最適点に辿りつくまで更新を繰り返す

単体法の基本アイデア



隣接する端点を求める

交点 \Leftrightarrow 基底/非基底変数の選択

$$x_1 = 0, x_2 = 0, x_3, x_4$$

隣接する交点 =

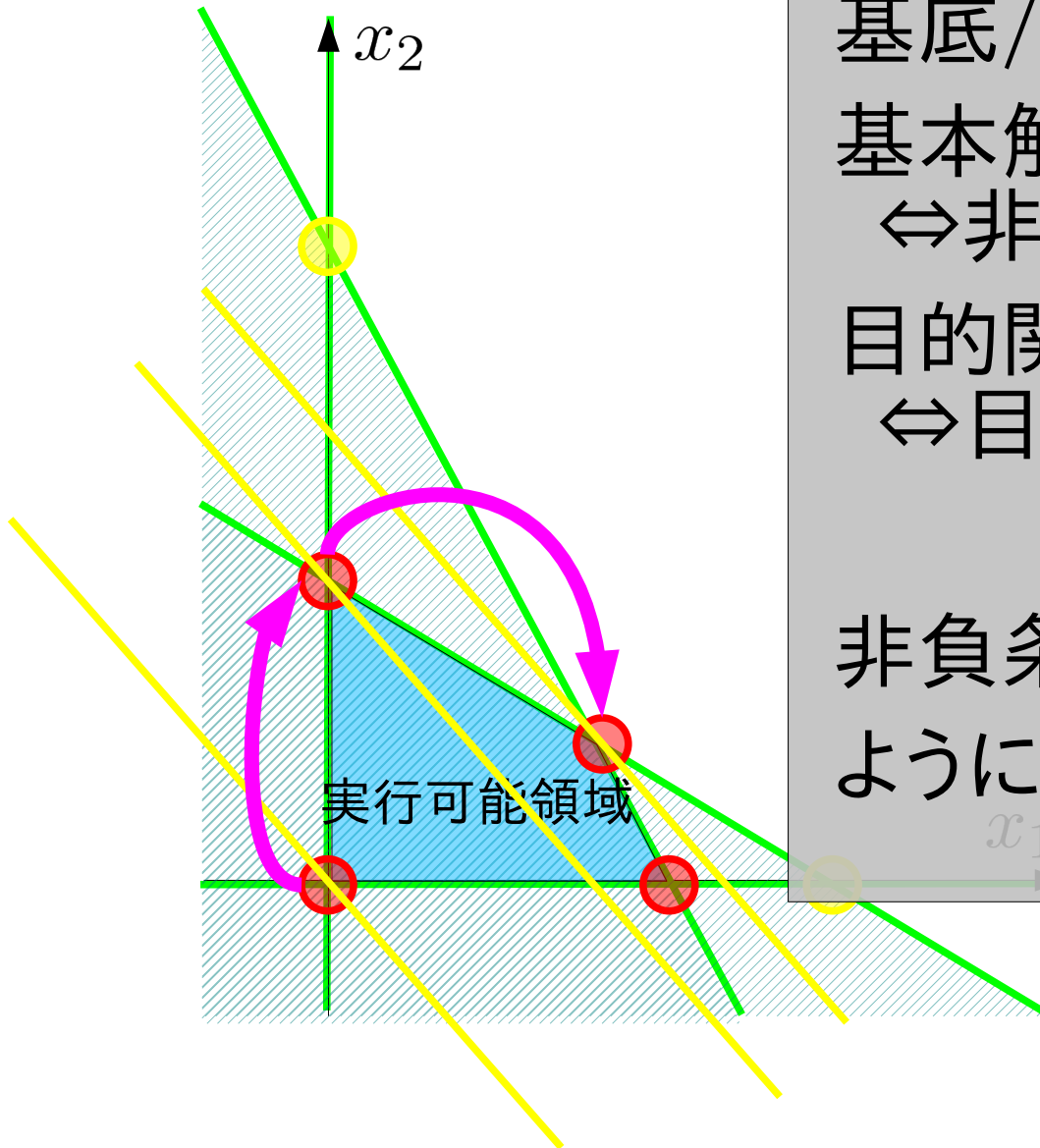
交点を成す直線が1つだけ異なる

\rightarrow 基底/非基底変数を1組替える

$$x_1 = 0, x_2 = 0, x_3, x_4$$

$$x_1 \implies x_1 = 0, x_2, x_3, x_4 = 0$$

単体法的基本的なアイデア



基底/非基底変数の交替候補
基本解が実行可能領域の端点
⇔非負条件を満たす

目的関数が改善する
⇔目的関数が減少する

非負条件を満たし、目的関数が減る
ように交替させる変数を選ぶ

単体法

1. 目的関数を z として変数と見做し、制約式を追加
2. 基底変数に z を含み、基本解が非負条件を満たすように変数を選ぶ
3. 次の条件で基底/非基底変数の交替候補を選ぶ
 - 交替後も非負条件を満たす
 - 交替により目的関数が改善する
4. 条件を満たす候補がなくなるまで交替を繰り返す

minimize z

subject to

$$z + 600x_1 + 500x_2 = 0$$

$$3x_1 + 1x_2 + 1x_3 = 45000$$

$$1x_1 + 2x_2 + 1x_4 = 40000$$

$$x_1, x_2, x_3, x_4 \geq 0$$

非基底変数: $x_1 = 0, x_2 = 0$

基本解:

$$(z, x_3, x_4) = (0, 45000, 40000)$$

(例)

単体法

- x_1 と x_2 が非基底変数

$$z + 600x_1 + 500x_2 = 0$$

$$\textcircled{1} \quad 3x_1 + 1x_2 + x_3 = 45000$$

$$\textcircled{2} \quad 1x_1 + 2x_2 + x_4 = 40000$$

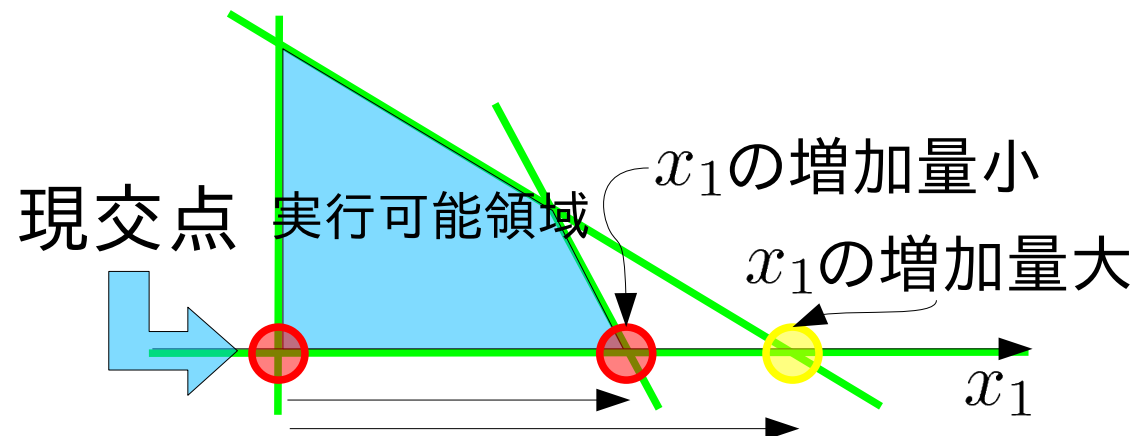
残り部分が連立方程式

- 交替候補を非基底変数から探す

x_1, x_2 のどちらかが正になる、どちらでも z は減少

- x_1 の最大増加量は
①で15000, ②で40000
 x_2 の最大増加量は
①で45000, ②で20000

- 基底変数になる変数の値は増加する ($0 \rightarrow$ 非負)
- 非基底変数になる変数は次交点を成す直線 (2次元の場合) に対応する
- 新しい基底変数の大小関係は下図の状況に対応する



シンプレックス表

- 交点の更新を表の上の操作で行う
等式標準形からシンプレックス表を作る

例:

$$\begin{aligned} & \text{minimize } z \\ & \text{subject to} \\ & \quad 3x_1 + 1x_2 + 1x_3 = 45000 \\ & \quad 1x_1 + 2x_2 + 1x_4 = 40000 \\ & \quad x_1, x_2, x_3, x_4 \geq 0 \\ & \quad z + 600x_1 + 500x_2 = 0 \end{aligned}$$

シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	3	1	1	0	45000	
0	1	2	0	1	40000	
1	600	500	0	0	0	

全ての等式の係数と右辺の定数を記入する

シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	3	1	1	0	45000	
0	1	2	0	1	40000	
1	600	500	0	0	0	

非基底変数
値は 0 (零)

基本解

全ての非負変数が非負(非基底変数はゼロ)なので、
基本解は実行可能解

- 基底変数/非基底変数の交替候補を探す
- 目的関数を含む等式(最下段)において、**係数が正**の非基底変数が基底変数になれば、目的関数は減少する
- 非基底変数の係数が大きいほど、目的関数は速く減少するものと考えて

ここでは x_1 を次の基底変数の候補とする

- 基底変数/非基底変数の交替候補を探す
- 目的関数を含む等式(最下段)において、**係数が正**の非基底変数が基底変数になれば、目的関数は減少する
- 非基底変数の係数が大きいほど、目的関数は速く減少するものと考えて

ここでは x_1 を次の基底変数の候補とする

シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	3	1	1	0	45000	15000 = 45000/3
0	1	2	0	1	40000	40000 = 40000/1
1	600	500	0	0	0	

- 各制約式の定数を x_1 の係数で割って最大増加量を求める
- 最小の最大増加量を与える制約式の基底変数を次の非基底変数の候補とする

ここでは x_3 を次の非基底変数の候補とする

ここでは x_1 を次の基底変数の候補とする
 ここでは x_3 を次の基底変数の候補とする

シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	3	1	1	0	45000	
0	1	2	0	1	40000	
1	600	500	0	0	0	

$\times 1/3$

新しい基底変数に関して連立方程式を解く
 シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	1	1/3	1/3	0	15000	
0	1	2	0	1	40000	
1	600	500	0	0	0	

$-\times 1$

$-\times 600$

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	1	1/3	1/3	0	15000	
0	0	5/3	-1/3	1	25000	
1	0	300	-200	0	-9E6	

新しい基底変数に関して連立方程式を解く
 シンプレックス表

基本解

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	1	1/3	1/3	0	15000	
0	0	5/3	-1/3	1	25000	
1	0	300	-200	0	-9E6	

全ての非負変数が非負なので、基本解は実行可能解

目的関数の式に正の係数を持つ非基底変数は唯一つ
 シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	1	1/3	1/3	0	15000	
0	0	5/3	-1/3	1	25000	
1	0	300	-200	0	-9E6	

$$= 15000 / (1/3)$$

$$= 25000 / (5/3)$$

新しい基底変数に関して連立方程式を解く

シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	1	1/3	1/3	0	15000	
0	0	5/3	-1/3	1	25000	
1	0	300	-200	0	-9E6	

$\times 3/5$

シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	1	1/3	1/3	0	15000	
0	0	1	-1/5	3/5	15000	
1	0	300	-200	0	-9E6	

$\left. \begin{array}{l} \leftarrow \times 1/3 \\ \leftarrow \times 300 \end{array} \right\}$

シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	定数	最大増加量
0	1	0	2/5	-1/5	10000	
0	0	1	-1/5	3/5	15000	
1	0	0	-140	-180	-135E5	

シンプレックス表

z	x_1	x_2	x_3	x_4	基本解 定数	最大増加量
0	1	0	2/5	-1/5	10000	
0	0	1	-1/5	3/5	15000	
1	0	0	-140	-180	-135E5	

全ての非負変数が非負なので、基本解は実行可能解

目的関数の式に正の係数を持つ非基底変数は無いので、これ以上の改善はできない。

この時点で最適解が基本解として得られている

$$x_1 = 10000$$

$$x_2 = 15000$$

$$x_3 = 0$$

$$x_4 = 0$$

$$z = -13,500,000$$

単体法 (simplex method)

最も基本的な単体法の手順

1. 目的関数を変数として含む制約式を構成する
2. 基本解が実行可能解となる基底/非基底変数を選ぶ
3. 目的関数を減少する新しい基底変数を選ぶ
4. 基底変数の最大増加量を小さくする非基底変数を選ぶ、
5. 基底変数・非基底変数の交換で得た連立方程式を解く
6. 目的関数を増加できる限り変数の交換を繰り返す
7. 目的関数を改善できなくなったら最適解が求まっている

問題点

最初の基本解撰択法、改善の停止と最適性の対応

次回：単体法の実践

次々回：単体法の二段階解法

演習問題3の解説