

数理計画法 第2回

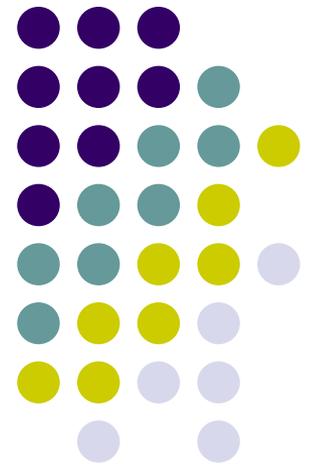
2. 1 線形計画問題と その標準形

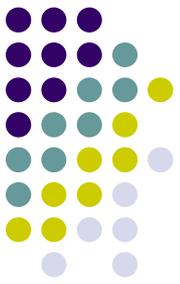
2. 2 双対問題

担当： 塩浦昭義
(情報科学研究科 准教授)

shioura@dais.is.tohoku.ac.jp

<http://www.dais.is.tohoku.ac.jp/~shioura/teaching/mp09/>





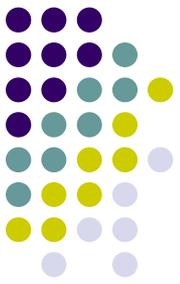
今日の講義の流れ

線形計画問題に関する用語と定理

- 不等式標準系, 等式標準系
- 双対問題
- LPの諸定理

2. 線形計画

2.1 線形計画問題とその標準形



線形計画問題(LP)の定義

- 目的関数が線形関数, 制約式も線形式の最適化問題

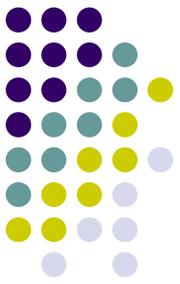
目的は「最大化」「最小化」
どちらでもよい

最大化 $2x + 2y + 3z$
条件 $5x + 3z \leq 8$
 $2z = 2$
 $4y + z \geq 9$
 $x, y \geq 0$

制約式は「 \geq 」「 $=$ 」「 \leq 」
どれでもよい

変数は
「不等号つき」「不等号なし」
どちらでもよい

LPの不等式標準形



任意の形のLPを扱う
のは面倒

⇒ **不等式標準形**

◆ 目的は**最小化**

◆ 制約式は「**左辺 \geq 右辺**」の形

◆ 各変数は**非負**

最小化 $c_1x_1 + c_2x_2 + \dots + c_nx_n$

条件 $a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n \geq b_1$

$$a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n \geq b_2$$

...

$$a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n \geq b_m$$

$$x_1 \geq 0, x_2 \geq 0, \dots, x_n \geq 0$$

不等式標準形への変形



命題2. 1: 任意のLPは不等式標準形に変換できる

次の4つの変換法を利用

【式と同値変形】 等式を二つの不等式で表現

$$\sum_{j=1}^n a_j x_j = b \quad \longrightarrow \quad \sum_{j=1}^n a_j x_j \leq b, \quad \sum_{j=1}^n a_j x_j \geq b$$

【目的関数の-1倍】 最大化から最小化へ

$$\text{最大化} \quad \sum_{j=1}^n c_j x_j \quad \longrightarrow \quad \text{最小化} \quad -\sum_{j=1}^n c_j x_j$$

【制約の-1倍】 不等式を“ \leq ”から“ \geq ”へ

$$\sum_{j=1}^n a_j x_j \leq b \quad \longrightarrow \quad -\sum_{j=1}^n a_j x_j \geq -b$$

不等式標準形への変形



【差による表現】

非負制約のない変数を2つの非負変数で表現

$$x_j \text{ (非負制約なし)} \longrightarrow x_j = x_{j1} - x_{j2}, x_{j1} \geq 0, x_{j2} \geq 0$$

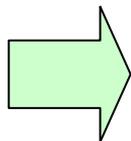
不等式標準形への変形の例



最大化 $3x + 2y$

条件 $x + y = 1$

$x \geq 0$



最大化 $3x + 2(y_1 - y_2)$

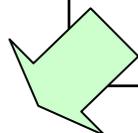
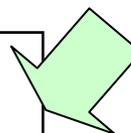
条件 $x + (y_1 - y_2) = 1$

$x \geq 0, y_1 \geq 0, y_2 \geq 0$

最小化 $-3x - 2(y_1 - y_2)$

条件 $x + (y_1 - y_2) = 1$

$x \geq 0, y_1 \geq 0, y_2 \geq 0$

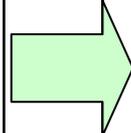


最小化 $-3x - 2(y_1 - y_2)$

条件 $x + (y_1 - y_2) \leq 1$

$x + (y_1 - y_2) \geq 1$

$x \geq 0, y_1 \geq 0, y_2 \geq 0$



最小化 $-3x - 2(y_1 - y_2)$

条件 $-x - (y_1 - y_2) \geq -1$

$x + (y_1 - y_2) \geq 1$

$x \geq 0, y_1 \geq 0, y_2 \geq 0$



「差による表現」による変形の妥当性

【差による表現】

$$x_j \text{ (非負制約なし)} \longrightarrow x_j = x_{j1} - x_{j2}, x_{j1} \geq 0, x_{j2} \geq 0$$

変換前の問題: P_1

変換後の問題: P_2

P1とP2は本質的に等価

- $(s_1, \dots, s_j, \dots, s_n)$: P_1 の許容解
 $\longrightarrow (s_1, \dots, s_{j1}, s_{j2}, \dots, s_n)$: P_2 の許容解, 目的関数値同じ
ただし $s_{j1} = s_j, s_{j2} = 0$ ($s_j \geq 0$ のとき)
 $s_{j1} = 0, s_{j2} = -s_j$ ($s_j < 0$ のとき)

例: $(x, y) = (3, -2)$ は $x + y = 1, x \geq 0$ を満たす
 $\Rightarrow (x, y_1, y_2) = (3, 0, 2)$ は $x + (y_1 - y_2) = 1, x, y_1, y_2 \geq 0$ を満たす



「差による表現」による変形の妥当性

【差による表現】

$$x_j \text{ (非負制約なし)} \longrightarrow x_j = x_{j1} - x_{j2}, x_{j1} \geq 0, x_{j2} \geq 0$$

変換前の問題: P_1

変換後の問題: P_2

P_1 と P_2 は本質的に等価

● $(t_1, \dots, t_{j1}, t_{j2}, \dots, t_n): P_2$ の許容解

$\longrightarrow (t_1, \dots, t_{j1} - t_{j2}, \dots, t_n): P_1$ の許容解, 目的関数値同じ

例: $(x, y_1, y_2) = (2, 1, 2)$ は $x + (y_1 - y_2) = 1, x, y_1, y_2 \geq 0$ を満たす
 $\Rightarrow (x, y) = (2, 1 - 2) = (2, -1)$ は $x + y = 1, x \geq 0$ を満たす

等式標準形



- LPの等式標準形

◆ 目的は**最小化**

◆ 制約は**等式**

◆ 各変数は**非負**

最小化 $C_1x_1 + C_2x_2 + \dots + C_nx_n$

条件 $a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1n}x_n = b_1$

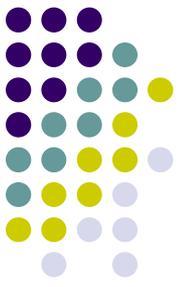
$$a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \dots + a_{2n}x_n = b_2$$

...

$$a_{m1}x_1 + a_{m2}x_2 + \dots + a_{mn}x_n = b_m$$

$$x_1 \geq 0, x_2 \geq 0, \dots, x_n \geq 0$$

等式標準形への変形



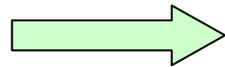
命題2. 2: 任意のLPは等式標準形に変換できる

- 任意のLPは不等式標準形に変換できる(命題2. 1)
- 不等式「左辺 \geq 右辺」を等式へ

$$\sum_{j=1}^n a_{ij} x_j \geq b_i \quad \longrightarrow \quad \sum_{j=1}^n a_{ij} x_j - x_{n+i} = b_i, \quad x_{n+i} \geq 0$$

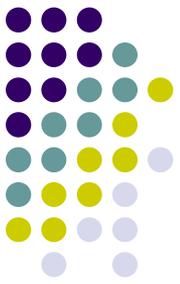
新しい非負変数 x_{n+i} を利用
(スラック変数)

$$\begin{aligned} 4x_1 - 3x_2 + x_3 &\geq -1 \\ x_1 \geq 0, x_2 \geq 0, x_3 \geq 0 \end{aligned}$$



$$\begin{aligned} 4x_1 - 3x_2 + x_3 - x_4 &= -1 \\ x_1 \geq 0, x_2 \geq 0, x_3 \geq 0, x_4 \geq 0 \end{aligned}$$

双対問題



- LPの最適値を下から見積もりたい
(最適値の下界値の計算)

最小化 $-2x_1 - x_2 - x_3$

→ 制約を足し合わせてみる

条件 $-2x_1 - 2x_2 + x_3 \geq -4$ ①

$-2x_1 - 4x_3 \geq -4$ ②

$4x_1 - 3x_2 + x_3 \geq -1$ ③

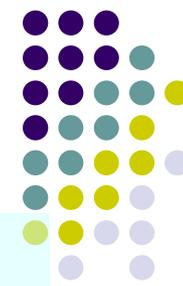
$x_1 \geq 0, x_2 \geq 0, x_3 \geq 0$

● 目的関数 \geq ② $\times 3 +$ ③ $= -2x_1 - 3x_2 - 11x_3 \geq -13$

● 目的関数 \geq ① $\times 0.5 +$ ② $\times 0.5 = -2x_1 - x_2 - 1.5x_3 \geq -4$

より良い
下界

双対問題



より一般に, 非負実数
 y_1, y_2, y_3 を使うと

$$\text{最小化 } -2x_1 - x_2 - x_3$$

$$\text{条件 } -2x_1 - 2x_2 + x_3 \geq -4 \quad \textcircled{1}$$

$$-2x_1 \quad - 4x_3 \geq -4 \quad \textcircled{2}$$

$$4x_1 - 3x_2 + x_3 \geq -1 \quad \textcircled{3}$$

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

$$\textcircled{1} \times y_1 + \textcircled{2} \times y_2 + \textcircled{3} \times y_3$$

$$\text{左辺: } (-2y_1 - 2y_2 + 4y_3)x_1 + (-2y_1 - 3y_3)x_2 + (y_1 - 4y_2 + y_3)x_3$$

$$\text{右辺: } -4y_1 - 4y_2 - y_3$$

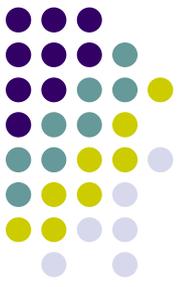
$$\left. \begin{aligned} -2y_1 - 2y_2 + 4y_3 &\leq -2 \\ -2y_1 \quad - 3y_3 &\leq -1 \\ y_1 - 4y_2 + y_3 &\leq -1 \end{aligned} \right\}$$

が成り立つならば

目的関数 \geq 左辺 \geq 右辺

$$= -4y_1 - 4y_2 - y_3$$

双対問題



最も大きな下界値を求めたい⇒新たなLP

$$\begin{aligned} \text{最大化} & \quad -4y_1 - 4y_2 - y_3 \\ \text{条件} & \quad -2y_1 - 2y_2 + 4y_3 \leq -2 \\ & \quad -2y_1 \quad \quad -3y_3 \leq -1 \\ & \quad \quad y_1 - 4y_2 + y_3 \leq -1 \\ & \quad y_1 \geq 0, y_2 \geq 0, y_3 \geq 0 \end{aligned}$$

もとの問題に
対する
双対問題

もとの問題・・・主問題

主問題と双対問題



主問題

最小化 $c_1x_1 + \dots + c_nx_n$

条件 $a_{11}x_1 + \dots + a_{1n}x_n \geq b_1$

$$a_{21}x_1 + \dots + a_{2n}x_n \geq b_2$$

...

$$a_{m1}x_1 + \dots + a_{mn}x_n \geq b_m$$

$$x_1 \geq 0, \dots, x_n \geq 0$$

双対問題

最大化 $b_1y_1 + b_2y_2 + \dots + b_my_m$

条件 $a_{11}y_1 + a_{21}y_2 + \dots + a_{m1}y_m \leq c_1$

$$a_{12}y_1 + a_{22}y_2 + \dots + a_{m2}y_m \leq c_2$$

...

$$a_{1n}y_1 + a_{2n}y_2 + \dots + a_{mn}y_m \leq c_n$$

$$y_1 \geq 0, y_2 \geq 0, \dots, y_m \geq 0$$

最小化 $\mathbf{c}^T \mathbf{x}$

条件 $A\mathbf{x} \geq \mathbf{b}$

$$\mathbf{x} \geq \mathbf{0}$$

行列表現

最大化 $\mathbf{b}^T \mathbf{y}$

条件 $A^T \mathbf{y} \leq \mathbf{c}$

$$\mathbf{y} \geq \mathbf{0}$$

主問題と双対問題



性質: 双対問題の双対問題は主問題に一致する

証明→レポート問題

手順(1) 双対問題を不等式標準形に書き換え

(2) 書き換えた問題の双対問題をつくる

(3) 得られた双対問題を変換すると

もとの問題に一致することを確かめる.

等式標準形の変換問題



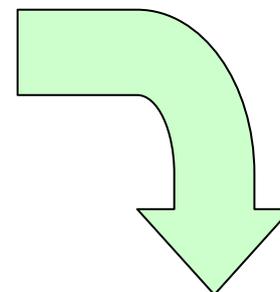
- LPの等式標準形

最小化 $\sum_{j=1}^n c_j x_j$

条件 $\sum_{j=1}^n a_{ij} x_j = b_i \quad (i = 1, 2, \dots, m)$

$x_j \geq 0 \quad (j = 1, 2, \dots, n)$

不等式標準形に



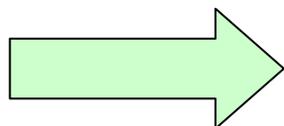
変換

最小化 $\sum_{j=1}^n c_j x_j$

条件 $\sum_{j=1}^n a_{ij} x_j \geq b_i, \quad -\sum_{j=1}^n a_{ij} x_j \geq -b_i \quad (i = 1, 2, \dots, m)$

$x_j \geq 0 \quad (j = 1, 2, \dots, n)$

等式標準形の双対問題



双対問題
をつくる

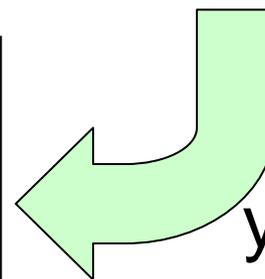
$$\text{最大化} \quad \sum_{i=1}^m b_i y_i' + \sum_{i=1}^m (-b_i) y_i''$$

$$\text{条件} \quad \sum_{i=1}^m a_{ij} y_i' + \sum_{i=1}^m (-a_{ij}) y_i'' \leq c_j \quad (j = 1, 2, \dots, n)$$

$$y_i' \geq 0, \quad y_i'' \geq 0 \quad (i = 1, 2, \dots, m)$$

$$\text{最大化} \quad \sum_{i=1}^m b_i y_i$$

$$\text{条件} \quad \sum_{i=1}^m a_{ij} y_i \leq c_j \quad (j = 1, 2, \dots, n)$$



$y_i' - y_i''$ を
非負制約なし変数
 y_i に置き換え

等式標準形のLPに対する双対問題