

МАТЕМАТИКА, Ч.2



Лекция 1

Лекцию читает

К.Т.Н., доцент

БОБРОВА

ЛЮДМИЛА ВЛАДИМИРОВНА



Кафедра информатики и компьютерных технологий

Рекомендуемая литература:

1. Ткаченко, Г. Г., Боброва Л.В. **Математика, ч. 2. Методы оптимизации:** учебно-методический комплекс. – СПб: Изд-во СЗТУ, 2009.

2. Ткаченко Г.Г. **Математика, ч. 2. Методы оптимизации:** учебное пособие. – СПб: Изд-во СЗТУ, 2007.

3. Таха Х.А. **Введение в исследование операций.** - М.: – Вильямс, 2008.





Оптимизация – это выбор наилучшего в некотором смысле решения.

Математическое (оптимальное) программирование -

раздел математики, разрабатывающий теорию и методы оптимизации управленческих и экономических задач.

1. Задача распределения ресурсов



Пример 1

Для производства двух видов продукции фирма использует два вида ресурсов:

ресурс1 – сырье,

ресурс 2 – время изготовления продукции на оборудовании.

Запасы ресурсов, нормы затрат каждого ресурса на единицу каждого продукта и рыночные цены приведены в табл.1.

Таблица 1

Ресурс	Нормы затрат на ед. продукции		Запас ресурса
	продукт1	продукт2	
сырье	$a_{11}=5$	$a_{12}=10$	$b_1=1000$
время изготовления	$a_{21}=0,1$	$a_{22}=0,3$	$b_2=25$
цена за ед. продукции	$c_1=40$	$c_2=100$	

Требуется найти план выпуска продукции, который обеспечивает **максимальную** выручку.

1.1 Построение математической модели

Обозначим: x_1 – план выпуска продукции 1,
 x_2 – план выпуска продукции 2.

Тогда затраты сырья и времени изготовления, необходимые для реализации плана x_1, x_2 , будут равны соответственно:

$$a_{11}x_1 + a_{12}x_2 = 5x_1 + 10x_2$$

$$a_{21}x_1 + a_{22}x_2 = 0,1x_1 + 0,3x_2$$

Ресурс	Нормы затрат на ед. продукции		Запас ресурса
	продукт1	продукт2	
сырье	$a_{11}=5$	$a_{12}=10$	$b_1=1000$
время изготовления	$a_{21}=0,1$	$a_{22}=0,3$	$b_2=25$
цена за ед. продукции	$c_1=40$	$c_2=100$	

План $X = (x_1, x_2)$ будет **допустимым**,
если затраты каждого ресурса
не превосходят их запасов,
т. е. выполняются неравенства:

$$5x_1 + 10x_2 \leq 1000$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 \leq 25$$

Ресурс	Нормы затрат на ед. продукции		Запас ресурса
	продукт1	продукт2	
сырье	$a_{11}=5$	$a_{12}=10$	$b_1=1000$
время изготовления	$a_{21}=0,1$	$a_{22}=0,3$	$b_2=25$
цена за ед. продукции	$c_1=40$	$c_2=100$	

Целевой функцией будет общая стоимость реализации плана (выручка) x_1, x_2 :

$$Z=40x_1+100x_2.$$

Ресурс	Нормы затрат на ед. продукции		Запас ресурса
	продукт1	продукт2	
сырье	$a_{11}=5$	$a_{12}=10$	$b_1=1000$
время изготовления	$a_{21}=0,1$	$a_{22}=0,3$	$b_2=25$
цена за ед. продукции	$c_1=40$	$c_2=100$	

Итак, необходимо найти план выпуска продукции x_1 , x_2 , который обеспечивает максимальную выручку

$$\max Z = 40 x_1 + 100 x_2,$$

при выполнении ограничений

$$\begin{aligned} 5 x_1 + 10 x_2 &\leq 1000, \\ 0,1 x_1 + 0,3 x_2 &\leq 25, \\ x_1 &\geq 0, \quad x_2 \geq 0. \end{aligned}$$

Это стандартная
задача линейного
программирования



Пример 2

Проверить является ли план $x_1=10, x_2=100$ допустимым.

Решение. Найдем затраты ресурсов на производство.

Для выполнения этого плана потребуется

$$5x_1 + 10x_2 = 5 \cdot 10 + 10 \cdot 100 = \mathbf{1050} \quad \text{кг сырья и}$$
$$0,1x_1 + 0,3x_2 = 0,1 \cdot 10 + 0,3 \cdot 100 = \mathbf{31} \quad \text{час работы}$$

оборудования.

Такой план выпуска **недопустим**, так как для его выполнения недостаточно ресурсов.

$$5x_1 + 10x_2 \leq \mathbf{1000},$$
$$0,1x_1 + 0,3x_2 \leq \mathbf{25},$$

Самостоятельная работа 1



Задание. В условиях *Примера 1* проверить допустимость плана решения при $x_1=20$, $x_2=50$

Варианты А. Допустимый.

ответов: В. Недопустимый.

$$\begin{aligned}5x_1 + 10x_2 &\leq 1000, \\0,1x_1 + 0,3x_2 &\leq 25,\end{aligned}$$

Сверим ответы?

$$x_1=20, \quad x_2=50$$

Для выполнения этого плана потребуется

$$5x_1 + 10x_2 = 5 \cdot 20 + 10 \cdot 50 = \mathbf{600} \quad \text{кг сырья и}$$
$$0,1x_1 + 0,3x_2 = 0,1 \cdot 20 + 0,3 \cdot 50 = \mathbf{17} \quad \text{час работы}$$

оборудования.

**План выпуска допустим,
для его выполнения достаточно ресурсов.**

$$5x_1 + 10x_2 \leq \mathbf{1000},$$
$$0,1x_1 + 0,3x_2 \leq \mathbf{25},$$



Пример 3

Для задачи Примера 1 найти выручку от реализации плана $x_1=10$, $x_2=100$.

Решение.

Выручка определяется целевой функцией

$$Z=40x_1+100x_2.$$

Значит,

$$Z=40*10+100*100 = 10400 \text{ (y.e.)}.$$



Самостоятельная работа 2



Задание. В условиях Примера 1
найти выручку от реализации
плана $x_1=20$, $x_2=50$

Варианты **A. 3000** **B. 3800**
ответов: **C. 5800** **D. 2900**

$$Z=40x_1+100x_2$$

Сверим ответы?

$$x_1=20, \quad x_2=50$$

Выручка определяется целевой функцией:

$$Z=40*20+100*50 = 5800 \text{ (y.e.)}.$$

$$Z=40x_1+100x_2$$



Пример 4

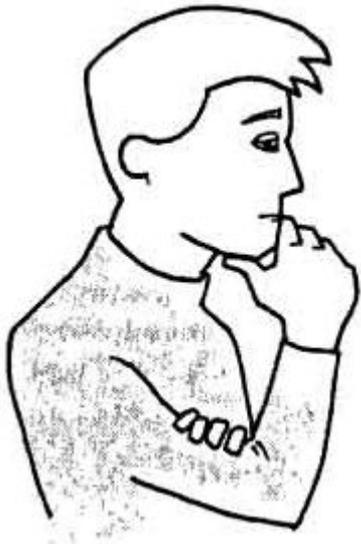
Для задачи Примера 1 найти остаток ресурсов при плане $x_1=50, x_2=50$.

Решение

Для выполнения этого плана потребуется

$$5x_1 + 10x_2 = 5 \cdot 50 + 10 \cdot 50 = 750 \quad \text{кг сырья и}$$
$$0,1x_1 + 0,3x_2 = 0,1 \cdot 50 + 0,3 \cdot 50 = 20 \quad \text{час работы}$$

оборудования.



Остатки ресурсов:

$$s_1 = 1000 - 750 = 250$$

$$s_2 = 25 - 20 = 5$$

$$\begin{aligned} 5x_1 + 10x_2 &\leq 1000, \\ 0,1x_1 + 0,3x_2 &\leq 25, \\ x_1 &\geq 0, \quad x_2 \geq 0. \end{aligned}$$

Самостоятельная работа 3

Задание. В условиях Примера 1
найти остаток ресурсов при
плане $x_1=30$, $x_2=70$



Варианты **A. 150; 3** **B. 150; 1**

ответов: **C. 250; 1** **D. 250; 3**

$$\begin{aligned}5x_1 + 10x_2 &\leq 1000, \\0,1x_1 + 0,3x_2 &\leq 25, \\x_1 &\geq 0, \quad x_2 \geq 0.\end{aligned}$$

Сверим ответы?

$$x_1=30, \quad x_2=70$$

Для выполнения этого плана потребуется

$$5x_1 + 10x_2 = 5 \cdot 30 + 10 \cdot 70 = \mathbf{850} \quad \text{кг сырья и}$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 = 0,1 \cdot 30 + 0,3 \cdot 70 = \mathbf{24} \quad \text{час работы}$$

оборудования.

Остатки ресурсов:

$$s_1 = 1000 - 850 = 150$$

$$s_2 = 25 - 24 = 1$$

$$\begin{aligned} 5x_1 + 10x_2 &\leq 1000, \\ 0,1x_1 + 0,3x_2 &\leq 25, \\ x_1 &\geq 0, \quad x_2 \geq 0. \end{aligned}$$



1.2. Определение оптимального плана производства графическим методом

Построим множество допустимых решений.

Проведем прямые

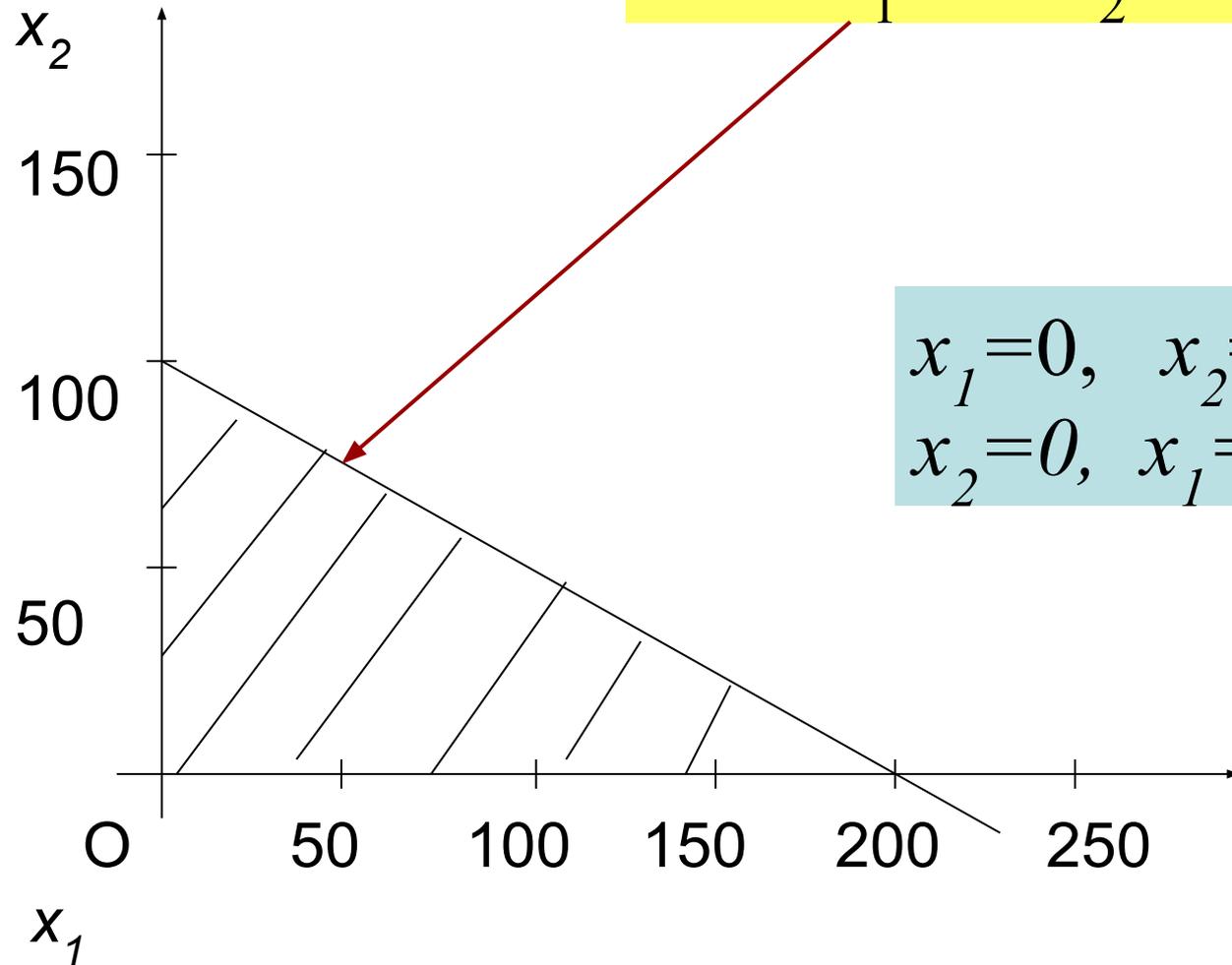
$$5x_1 + 10x_2 = 1000: (x_1=0, x_2=1000/10=100, \\ x_2=0, x_1=1000/5=200.)$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 = 25: (x_1=0, x_2=25/0,3=250/3=83,3, \\ x_2=0, x_1=25/0,1=250).$$

$$5x_1 + 10x_2 \leq 1000, \\ 0,1x_1 + 0,3x_2 \leq 25, \\ x_1 \geq 0, x_2 \geq 0.$$

Строим прямую

$$5x_1 + 10x_2 = 1000$$

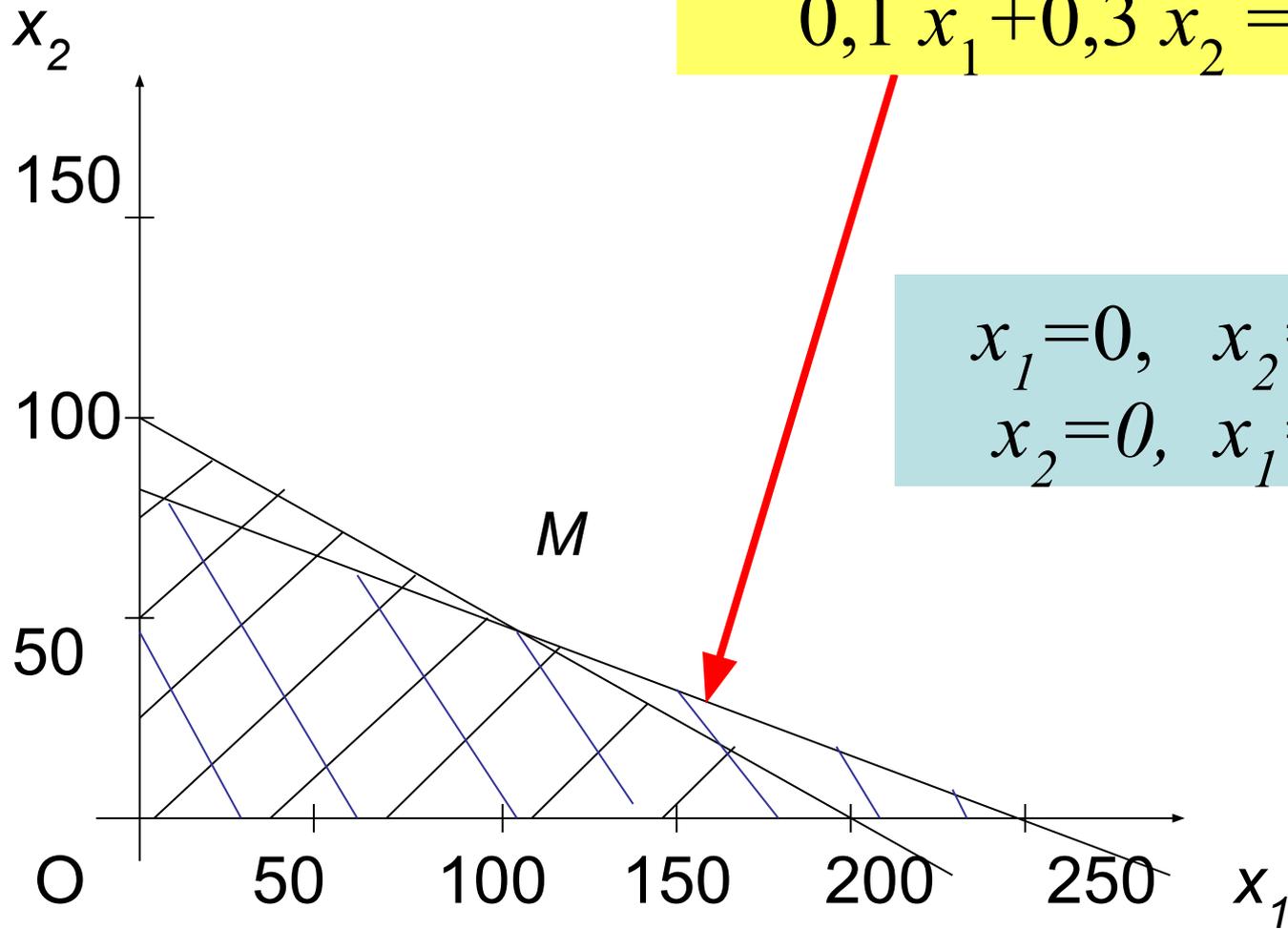


$$x_1 = 0, \quad x_2 = 100,$$
$$x_2 = 0, \quad x_1 = 200.$$

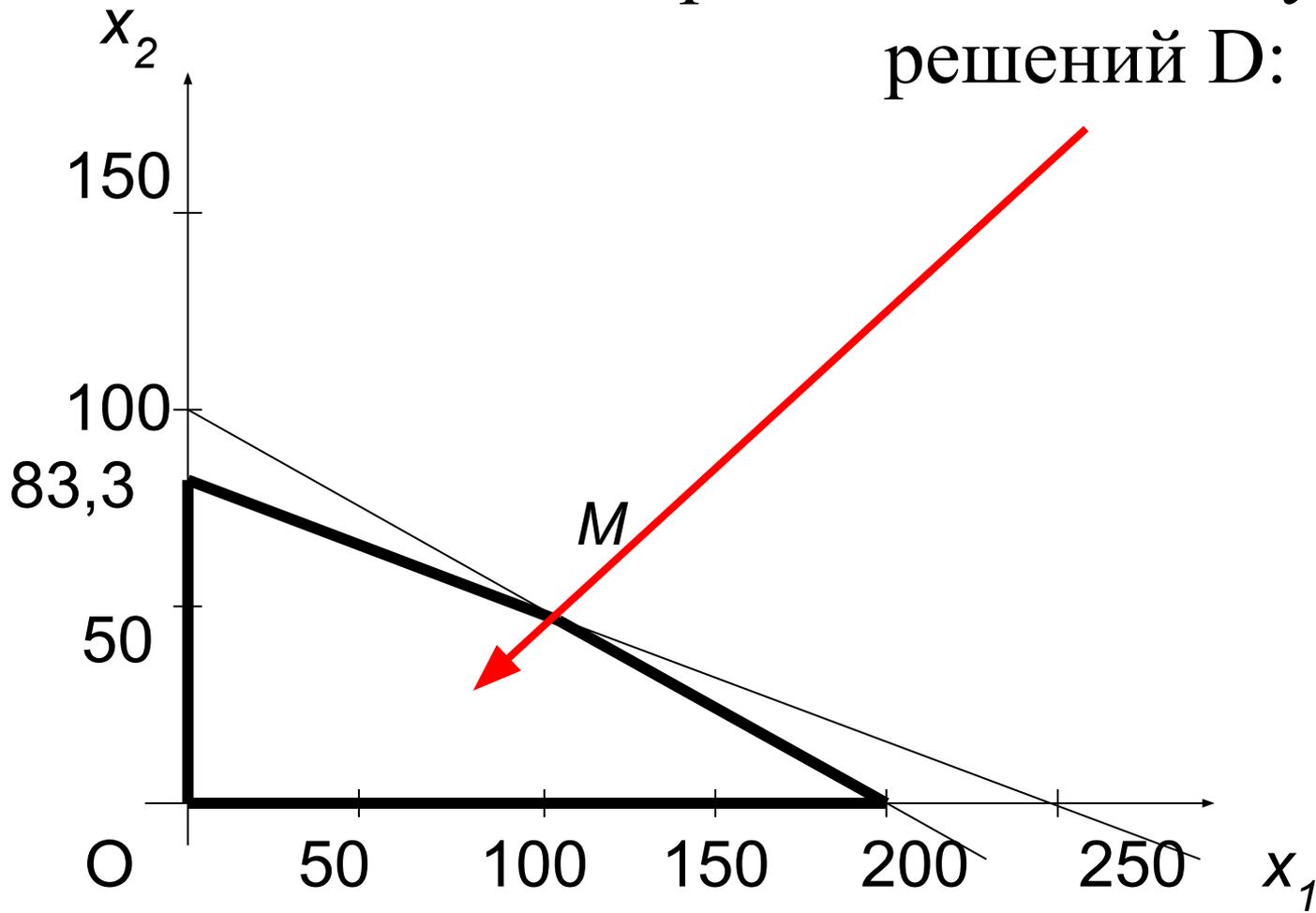
Строим прямую

$$0,1 x_1 + 0,3 x_2 = 25$$

$$\begin{aligned} x_1 = 0, & \quad x_2 = 83,3, \\ x_2 = 0, & \quad x_1 = 250. \end{aligned}$$

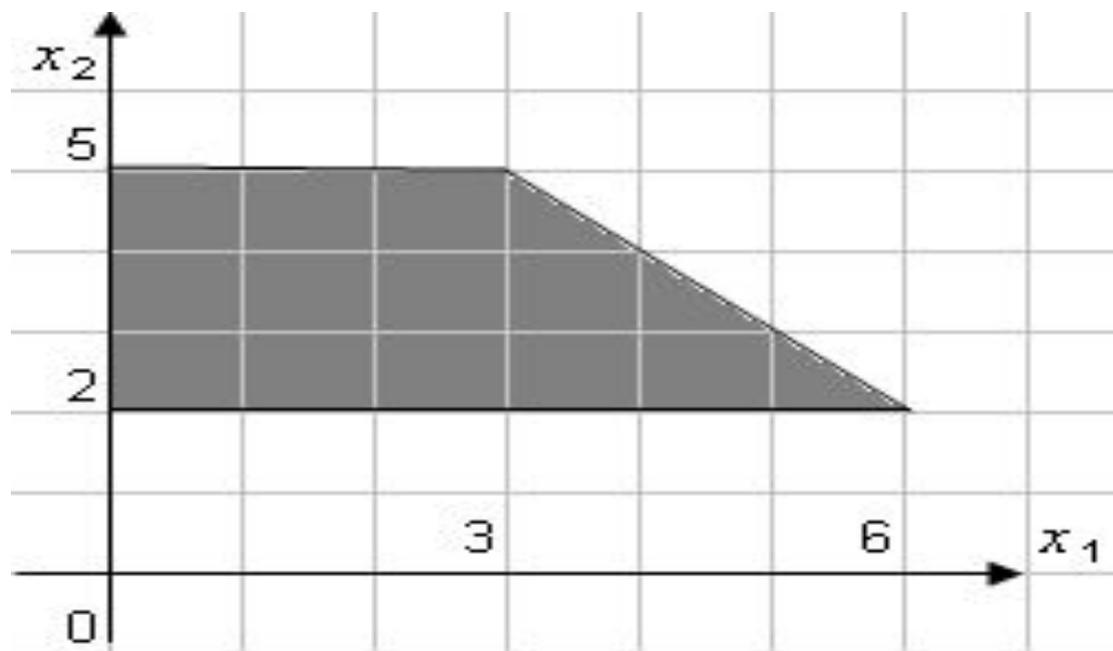


Строим область допустимых
решений D:



Самостоятельная работа 4

Задание. Область допустимых решений задачи линейного программирования имеет вид:



Тогда максимальное значение функции $Z = 2x_1 + 2x_2$ равно: **A.** 11. **B.** 13. **C.** 16. **D.** 8.

1.3. Приведение задачи Примера 1 к канонической форме.

Для этого введем две дополнительные переменные: s_1 и s_2 (s_1 - остаток сырья, s_2 - остаток времени изготовления).

Тогда получим **каноническую форму** задачи:

найти план x_1, x_2, s_1, s_2 , который дает максимальную выручку

$$Z = 40 \cdot x_1 + 100 \cdot x_2 + 0 \cdot s_1 + 0 \cdot s_2 \quad (1)$$

при ограничениях:

$$5x_1 + 10x_2 + s_1 = 1000 \quad (2)$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 + s_2 = 25$$

$$x_1 \geq 0, x_2 \geq 0, s_1 \geq 0, s_2 \geq 0$$

$$\begin{aligned} 5x_1 + 10x_2 &\leq 1000, \\ 0,1x_1 + 0,3x_2 &\leq 25, \\ x_1 &\geq 0, \quad x_2 \geq 0. \end{aligned}$$

$$Z = 40x_1 + 100x_2$$

1.4. Определение всех базисных решений

Ограничения (2) образуют систему двух уравнений с **четырьмя неизвестными**.

Среди бесконечного множества решений этой системы *базисные решения* получаются следующим образом.

Две переменных приравняем к 0.

Эти переменные назовем *свободными*.



Значения остальных переменных получаем из решения системы.

Эти переменные назовем *базисными*.

Базисное решение называется *допустимым*, если оно неотрицательно.



1. Пусть x_1, x_2 – свободные переменные.

Подставляя значения $x_1 = 0, x_2 = 0$

в (2) , получаем систему уравнений:

$$s_1 = 1000$$

$$s_2 = 25$$

Следовательно, базисное решение имеет вид:

$$\mathbf{x_1 = 0, x_2 = 0, s_1 = 1\ 000, s_2 = 25.}$$

$$5x_1 + 10x_2 + s_1 = 1000 \quad (2)$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 + s_2 = 25$$

$$Z = 40x_1 + 100x_2$$

Базисное решение означает,
что первой и второй продукт
не производятся.

Это базисное решение **является
допустимым**

Выручка от реализации этого плана составит

$$Z = 40 x_1 + 100 x_2 = 0.$$

$$Z = 40x_1 + 100x_2$$

$$x_1 = 0, x_2 = 0, s_1 = 1\ 000, s_2 = 25.$$

2. Пусть x_1, s_1 – свободные переменные.

Подставляя значения $x_1 = 0, s_1 = 0$ в (2), получаем систему

$$10x_2 = 1000$$

$$0,3x_2 + s_2 = 25$$

Следовательно, базисное решение имеет вид

$$\mathbf{x_1 = 0, x_2 = 100, s_1 = 0, s_2 = -5.}$$

$$5x_1 + 10x_2 + s_1 = 1000$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 + s_2 = 25 \quad (2)$$

Это базисное решение означает,
что первый продукт не производится,
второго продукта производится 100.

Сырье полностью используется в производстве,

Для производства не хватает
5 часов работы оборудования.

Это базисное решение *не является допустимым*.

$$x_1 = 0, \quad x_2 = 100, \quad s_1 = 0, \quad s_2 = -5.$$

3. Пусть x_1, s_2 - свободные переменные.

Подставляя значения $x_1=0, s_2=0$ в (2) ,

получаем систему

$$10x_2 + s_1 = 1000$$

$$0,3x_2 = 25$$

Следовательно, базисное решение имеет вид

$$\mathbf{x_1 = 0, x_2 = 250/3 = 83 \frac{1}{3}, s_1 = 166 \frac{2}{3}, s_2 = 0.}$$

$$5x_1 + 10x_2 + s_1 = 1000$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 + s_2 = 25 \quad (2)$$

Это базисное решение означает,
что первый продукт не производится,
второго продукта производится **83 1/3**.

Сырье не полностью используется в производстве
и его остаток составляет **166 2/3 кг**.

Время работы оборудования полностью
используется в производстве.

Это базисное решение является *допустимым*.
Выручка от реализации этого плана составит

$$Z = 40x_1 + 130x_2 = 10433 \frac{1}{3}.$$

$$Z = 40x_1 + 100x_2$$

$$x_1 = 0, \quad x_2 = 250/3 = 83 \frac{1}{3}, \quad s_1 = 166 \frac{2}{3}, \quad s_2 = 0.$$

4. Пусть x_2, s_1 - свободные переменные.

Подставляя значения $x_2 = 0, s_1 = 0$ в (2),

получаем систему

$$5x_1 = 1000,$$

$$0,3x_2 = 25$$

Следовательно, базисное решение имеет вид

$$\mathbf{x_1 = 0, x_2 = 250/3 = 83 \frac{1}{3}, s_1 = 166 \frac{2}{3}, s_2 = 0.}$$

$$5x_1 + 10x_2 + s_1 = 1000$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 + s_2 = 25 \quad (2)$$

Базисное решение означает,
что первого продукта производится 200,
второй продукт не производится.

Сырье полностью используется в производстве.

Время обработки не полностью используется в
производстве.

Это базисное решение является *допустимым*.

Выручка от реализации этого плана составит

$$Z = 40x_1 + 130x_2 = 8000.$$

$$Z = 40x_1 + 100x_2$$

$$x_1 = 0, \quad x_2 = 250/3 = 83 \frac{1}{3}, \quad s_1 = 166 \frac{2}{3}, \quad s_2 = 0.$$

5. Пусть x_2, s_2 – свободные переменные.

Подставляя значения $x_2 = 0, s_2 = 0$ в (2),

получаем систему

$$5x_1 + s_1 = 1000$$

$$0,1x_1 = 25$$

Следовательно, базисное решение имеет вид

$$x_1 = 250, \quad x_2 = 0, \quad s_1 = -250, \quad s_2 = 0.$$

$$5x_1 + 10x_2 + s_1 = 1000$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 + s_2 = 25 \quad (2)$$

Это базисное решение означает,
что первого продукта производится 250,
второй продукт не производится.

Не хватает для производства 250 кг сырья,
Время работы оборудования используется
полностью.

Это базисное решение *не является*
допустимым.

$$x_1 = 250, \quad x_2 = 0, \quad s_1 = -250, \quad s_2 = 0.$$

6. Пусть s_1, s_2 – свободные переменные.

Тогда базисные переменные x_1 и x_2
найдем из системы уравнений

$$5x_1 + 10x_2 = 1000$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 = 25$$

Отсюда следует, что базисное решение имеет вид

$$x_1 = 100, \quad x_2 = 50, \quad s_1 = 0, \quad s_2 = 0.$$

$$\begin{aligned} 5x_1 + 10x_2 + s_1 &= 1000 \\ 0,1x_1 + 0,3x_2 + s_2 &= 25 \end{aligned} \quad (2)$$

Это базисное решение означает,
что первого продукта производится 100,
второго продукта производится 50.

Сырье и время работы оборудования
используются полностью.

Это базисное решение является *допустимым*.
Выручка от реализации этого плана составит

$$Z = 40 \cdot 100 + 130 \cdot 50 = 10500.$$

$$Z = 40x_1 + 130x_2$$

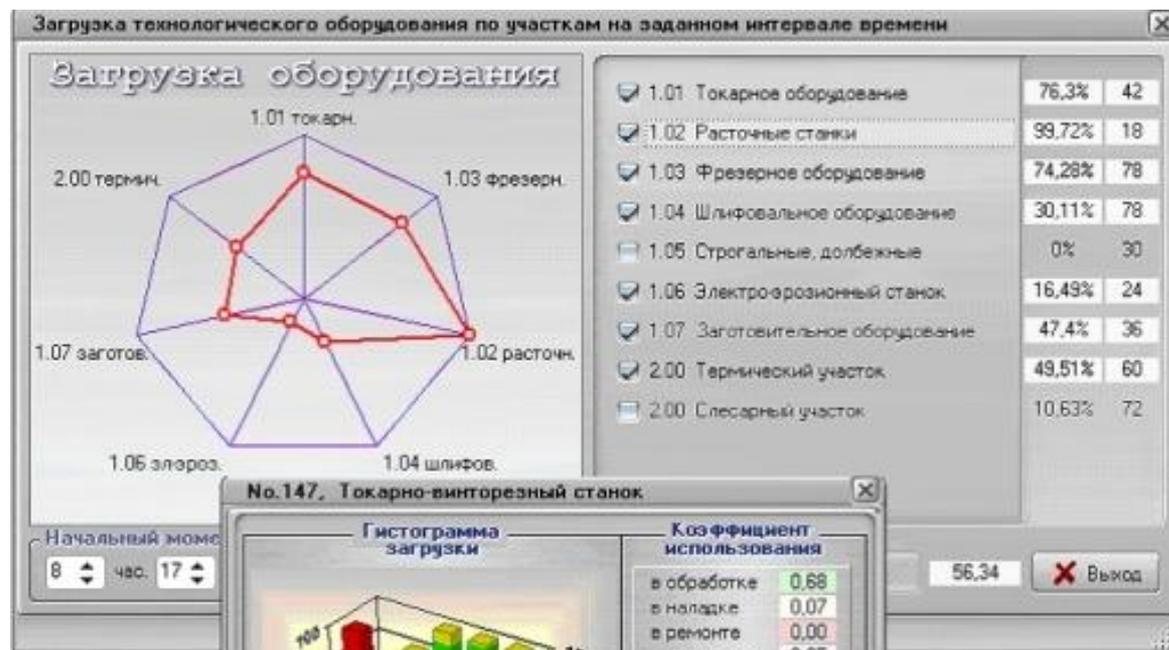
$$x_1 = 100, \quad x_2 = 50, \quad s_1 = 0, \quad s_2 = 0.$$

№	Базисные переменные		Небазисные переменные		Z
1	$S_1=1000$	$S_2=25$	$X_1=0$	$X_2=0$	0
2	$X_2=250/3$	$S_1=160 \frac{2}{3}$	$X_1=0$	$S_2=0$	$Z=10433 \frac{1}{3}$
3	$X_1=200$	$S_2=5$	$X_2=0$	$S_1=0$	$Z=8000$
4	$X_1=100$	$X_2=50$	$S_1=0$	$S_2=0$	$Z=10500$

Максимальное значение выручки достигается на четвертом базисном решении в этой таблице

$$X^* = \{ x_1=100; x_2=50; S_1=0; S_2=0 \}$$

2.3. РЕШЕНИЕ ЗАДАЧ ЛИНЕЙНОГО ПРОГРАММИРОВАНИЯ СИМПЛЕКС-МЕТОДОМ



Построение симплекс-таблицы для Примера

$$5x_1 + 10x_2 + s_1 = 1000,$$

$$0,1x_1 + 0,3x_2 + s_2 = 25,$$

$$Z = 40x_1 + 100x_2 + 0s_1 + 0s_2.$$

Таблица 2

БП	Значения b	x_1	x_2	s_1	s_2	
s_1	1000	5	10	1	0	
s_2	25	0,1	0,3	0	1	
Z	0	-40	-100	0	0	

Получили план:

$$X^{(0)} = \{x_1=0, x_2=0, s_1=1000, s_2=25\}.$$

Анализ оптимальной симплекс-таблицы

1. Значения второго столбца определяют значения БП:

$$x_1 = 100; x_2 = 50.$$

Все переменные, не входящие в первый столбец, являются свободными и равны 0: $s_1 = 0, s_2 = 0$.

БП	Значение b'	x_1	x_2	s_1	s_2
x_1	100	1	0	3/5	-20
x_2	50	0	1	-1/5	10
Z	9000	0	0	4	200



Анализ оптимальной симплекс-таблицы

Базисное решение прямой задачи:

$$X^2 = \{x_1=100; x_2 = 50; S_1 = 0; S_2 = 0\}$$

БП	Значение b'	x_1	x_2	s_1	s_2
x_1	100	1	0	3/5	-20
x_2	50	0	1	-1/5	10
Z	9000	0	0	4	200



Анализ оптимальной симплекс-таблицы

2. В последней строке определяются:

- значение ЦФ прямой задачи $Z=9000$;
- значения 0 в столбцах x_1 и x_2 означают, что производства первого и второго продуктов рентабельны: $\Delta 1=0, \Delta 2=0$.
(при положительных Δ производство нерентабельно)

БП	Значение b'	x_1	x_2	s_1	s_2
x_1	100	1	0	3/5	-20
x_2	50	0	1	-1/5	10
Z	9000	0	0	4	200



Самостоятельная работа

Задание. Оптимальная симплекс-таблица задачи линейного программирования (планирования производства продукции) имеет вид:

№	Базисные	Значения	Коэффициенты			
	переменные		x_1	x_2	x_3	x_4
1	x_2	2,00	1,25	1,00	0,25	0,00
2	x_4	6,00	0,25	0,00	-0,75	1,00
3	Z	8	3	0	1	0

Тогда оптимальный план выпуска продукции равен:

A. $x_1 = 0$; $x_2 = 2$.

B. $x_1 = 6$; $x_4 = 6$.

C. $x_3 = 1,25$; $x_2 = 1$.

D. $x_2 = 2$; $x_4 = 6$

Самостоятельная работа

Задание. Оптимальная симплекс-таблица задачи линейного программирования (планирования производства продукции) имеет вид:

№	Базисные	Значения	Коэффициенты			
	переменные		x_1	x_2	x_3	x_4
1	x_2	2,00	1,25	1,00	0,25	0,00
2	x_4	6,00	0,25	0,00	-0,75	1,00
3	Z	8	3	0	1	0

Тогда максимальное значение целевой функции равно
А. 3 В. 6 С. 8 D. 1,25

1.3.3. Построение двойственной задачи линейного программирования

Прямая задача

$$\begin{aligned}5x_1 + 10x_2 &= 1000, \\0,1x_1 + 0,3x_2 &= 25, \\Z &= 40x_1 + 100x_2 + 0S_1 + 0S_2\end{aligned}$$

Двойственная задача ЛП:

$$x_1 \rightarrow 5y_1 + 0,1y_2 \geq 40,$$

$$x_2 \rightarrow 10y_1 + 0,3y_2 \geq 100,$$

$$s_1 \rightarrow y_1 \geq 0,$$

$$s_2 \rightarrow y_2 \geq 0.$$

$$W = 1000y_1 + 25y_2, \longrightarrow \min$$

Анализ оптимальной симплекс-таблицы

Значение **4** в столбце s_1 означает, что теневая цена 1 кг сырья равна 4 : $y_1 = 4$;

Значение **200** в столбце s_2 означает, что теневая цена работы 1 часа оборудования равна **200**: $y_2 = 200$.

БП	Значение b'	x_1	x_2	s_1	s_2
x_1	100	1	0	3/5	-20
x_2	50	0	1	-1/5	10
Z	9000	0	0	4	200
		Δ_1	Δ_2	y_1	y_2



2.3. Интервалы устойчивости.

После нахождения оптимального решения выполняется анализ модели на **чувствительность** – необходимо знать какими будут возможные **изменения решения** при **изменении параметров** системы.



Решение задачи в Excel

В электронную таблицу внести исходные данные :

	А	В	С	Д	Е	Ф	Г
1							
2		переменные					
3		х ₁ прод 1	х ₂ прод 2				
4	значение	1	1				
5							
6	коэф в ЦФ	40	100	140	макс		
7							
8		ограничения					
9	вид ресурса			затраты ресурса	знак	запас ресурса	
10	сырье	5	10	15	<=	1000	
11	время	6	18	24	<=	25	
12							

Сервис – Поиск решения

Поиск решения [?] [X]

Установить целевую ячейку: [icon]

Равной: максимальному значению значению:

минимальному значению

Изменяя ячейки: [icon]

Ограничения: [icon]

В Поиске решения –Параметры - Заполнить окно -ОК

Параметры поиска решения



Максимальное время:

секунд

ОК

Предельное число итераций:

Отмена

Относительная погрешность:

Загрузить модель...

Допустимое отклонение:

%

Сохранить модель...

Сходимость:

Справка

Линейная модель

Автоматическое масштабирование

Неотрицательные значения

Показывать результаты итераций

Оценки

линейная

квадратичная

Разности

прямые

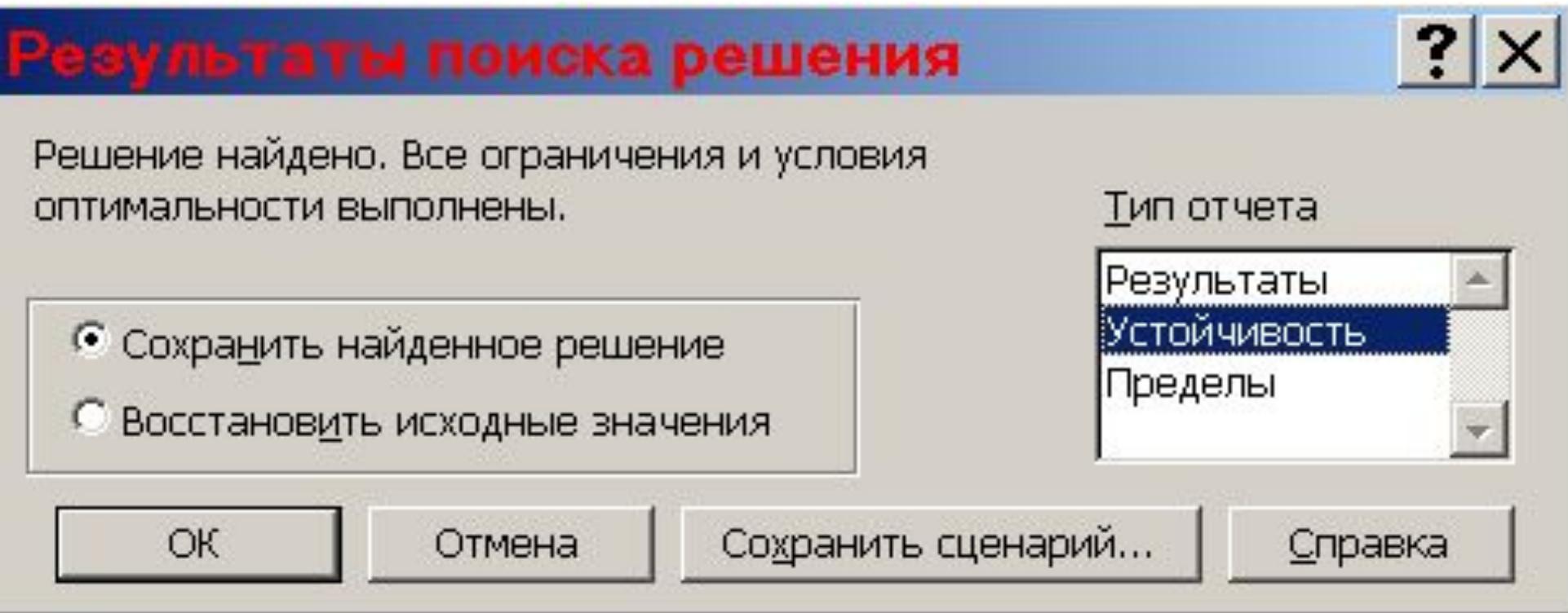
центральные

Метод поиска

Ньютона

сопряженных градиентов

В Поиске решения Выполнить Выделить Устойчивость - ОК



Спасибо за
внимание

Спасибо за
внимание