

8. CVIČENÍ Z OPTIMALIZACE

Dualita

D: Mějme lineární program s n proměnnými a m podmínkami:

$$\max c^T x, \quad Ax \leq b, \quad x \geq 0$$

Pak jeho *duálem* nazveme následující lineární program s m proměnnými a n podmínkami:

$$\min b^T y, \quad A^T y \geq c, \quad y \geq 0$$

T(Slabá věta o dualitě): Mějme maximalizační lineární program $\max c^T x$ a duální minimalizační program $\min b^T y$. Pak pro libovolné řešení x a libovolné řešení duálu y platí, že $c^T x \leq b^T y$.

Jinými slovy, hodnota duálního řešení je horní odhad na hodnotu libovolného primárního řešení.

T(Silná věta o dualitě): Pro úlohy

$$\max c^T x \text{ za podmínek } Ax \leq b \text{ a } x \geq 0 \quad (\text{P})$$

$$\min b^T y \text{ za podmínek } A^T y \geq c \text{ a } y \geq 0 \quad (\text{D})$$

nastane právě jedna z následujících možností:

1. Ani (P), ani (D) nemá přípustné řešení.
2. (P) je neomezená a (D) nemá přípustné řešení.
3. (P) nemá přípustné řešení a (D) je neomezená.
4. Jak (P), tak (D) mají přípustné řešení. Pak existuje optimální řešení x^* úlohy (P) a optimální řešení y^* úlohy (D) a platí

$$c^T x^* = b^T y^*,$$

tedy *maximum (P) je rovno minimu (D)*.

<i>Původní program:</i>	<i>V duálu bude:</i>
maximum	minimum
$\max c^T x$	$\min b^T y$
m podmínek n proměnných	m proměnných n podmínek
i -tá podmínka má \leq	$y_i \geq 0$
i -tá podmínka má \geq	$y_i \leq 0$
i -tá podmínka má $=$	$y_i \in \mathbb{R}$
$x_j \geq 0$	j -tá podmínka má \geq
$x_j \leq 0$	j -tá podmínka má \leq
$x_j \in \mathbb{R}$	j -tá podmínka má $=$

PŘÍKLAD PRVNÍ

Sestrojte duální úlohu k následující úloze:

$$\begin{aligned} \max x_1 - 2x_2 + 3x_4 \\ x_2 - 6x_3 + x_4 &\leq 4 \\ -x_1 + 3x_2 - 3x_3 &= 0 \\ 6x_1 - 2x_2 + 2x_3 - 4x_4 &\geq 5 \\ x_2 &\leq 0 \\ x_4 &\geq 0 \end{aligned}$$

PŘÍKLAD DRUHÝ Sestrojte duální úlohu k lineární relaxaci úlohy MINIMÁLNÍ VRCHOLOVÉ POKRYTÍ pro vážený graf $G = (V, E, w)$. Pro připomenutí, úloha vypadá takto:

$$\begin{aligned} \min \sum_{v \in V} w(v)x_v \\ \forall e = (uv) \in E : x_u + x_v &\geq 1 \\ \forall v \in V : x_v &\geq 0 \end{aligned}$$

Doplňující otázka: Jaký problém řeší duální program?

PŘÍKLAD TŘETÍ Představme si zadání lineárního programu, jehož řešení zatím neznáme:

$$\max c^T x, Ax \leq b, x \geq 0$$

Pomocí duality zkonstruujte nový lineární program, který splňuje:

- neobsahuje účelovou funkci,
- ze souřadnic libovolného přípustného řešení jde vyčíst optimální řešení původního.

PŘÍKLAD ČTVRTÝ Zformulujte lineární program, který řeší úlohu NEJKRATŠÍ s, t -CESTA v neorientovaném neohodnoceném grafu. Vysvětlete hlavní ideu vašeho lineárního programu. Až budete mít daný lineární program, zkonstruujte k němu duál.

Doplňující otázka: Má i váš duální program nějakou hlavní ideu?

PŘÍKLAD PÁTÝ Nalezněte program, který je nepřipustný a jeho duál je také nepřipustný.

PŘÍKLAD ŠESTÝ Dokažte nebo vyvráťte tvrzení:

- pro každý lineární program L platí, že duál duálu L je původní program L .
- Pokud má lineární program optimum s celočíselnými proměnnými, tak má celočíselné optimální řešení i duál.