

Introdução Algoritmo Simplex Modelagem

Introdução à Otimização INTRODUÇÃO II

Haroldo Gambini Santos
Universidade Federal de Ouro Preto

15 de março de 2011

Introdução à Otimização, INTRODUÇÃO II 1 / 17

Notas

Introdução Algoritmo Simplex Modelagem

Conteúdo

- 1 Introdução
- 2 Algoritmo Simplex
- 3 Modelagem

Introdução à Otimização, INTRODUÇÃO II 2 / 17

Notas

Introdução **Algoritmo Simplex** Modelagem

Algoritmo Simplex - Visão Geral

- o algoritmo inicia em algum vértice factível;
ex.: $(0,0)$
- a cada iteração, são pesquisados vértices vizinhos e o mesmo se move para o que oferecer melhora (método de subida - *Hill Climbing*);
- sem vizinhos de melhora ? solução ótima !

Introdução à Otimização, INTRODUÇÃO II 3 / 17

Notas

Algoritmo Simplex - Visão Geral

Maximize:

$$x_1 + 6x_2 + 13x_3$$

Sujeito a:

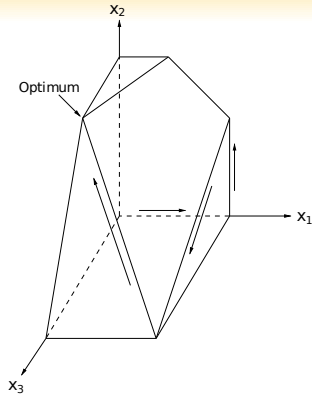
$$x_1 \leq 200$$

$$x_2 \leq 300$$

$$x_1 + x_2 + x_3 \leq 400$$

$$x_2 + 3x_3 \leq 600$$

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



Notas

Algoritmo Simplex - Visão Geral

Como cresce o nr. de vértices do poliedro ?



mesmo com 3 variáveis (3 dimensões)

a adição de restrições aumenta muito o nr. de vértices !

À primeira vista o algoritmo parece muito ineficiente.

Notas

Algoritmo Simplex - Implementações

Garantias

- no *pior caso*, o algoritmo tem complexidade exponencial
- na *prática*, os problemas são resolvidos entre $2m$ e $3m$ iterações

Progressos

“Programas Lineares com milhares ou milhões de variáveis são rotineiramente resolvidos utilizando-se o algoritmo simplex com computadores modernos.”

Overton, M.L. 1997

Notas

Programação Linear - Pacotes de Software

Comerciais

- IBM ILOG CPLEX
- GUROBI

Código Aberto

- GNU GLPK Linear Programming Kit
- COIN-OR CLP / CBC

Notas

Modelagem - Planejamento da Produção

Nossa companhia fabrica tapetes artesanais, um produto com demanda sazonal. Obtivemos as demandas d_1, d_2, \dots, d_{12} para o ano que se inicia. As mesmas variam desde 440 até 920.

Atualmente a empresa tem 30 empregados, cada um dos quais faz 20 tapetes por mês e recebe \$ 2.000,00. A companhia está sem estoque de carpetes.

As flutuações de demanda podem ser gerenciadas do seguinte modo:

- 1 **trabalho extra:** nesse caso paga-se 80% a mais do que o salário regular; cada funcionário pode ter um máximo de 30% de trabalho a mais no mês;
- 2 **contratar ou despedir:** custo de \$ 320 e \$ 400, respectivamente;
- 3 **manter estoques:** custa \$ 8 por tapete por mês; atualmente não temos tapetes estocados e precisamos terminar o ano sem estoque também.

Como atender toda a demanda minimizando os custos de produção ?

Notas

Plan. Prod. - Variáveis

t_i trabalhadores no i -ésimo mês; ($t_0 = 30$);

x_i número de tapetes feitos i -ésimo mês;

e_i número de tapetes feitos utilizando-se trabalho extra no mês i ;

c_i, d_i respectivamente: contratados e demitidos no início do mês i ;

a_i número de tapetes armazenados ao final do mês i ($a_0 = 0$).

Notas

Introdução Algoritmo Simplex Modelagem

Plan. Prod. - Restrições

Produção mês i ($i = 1, \dots, 12$)

$$x_i = 20t_i + e_i$$

Máximo prod. com trab. extra ($20 \times 0,3$)

$$e_i \leq 6t_i$$

Tapetes armezados no final do mês i

$$a_i = a_{(i-1)} - demanda_i + x_i$$

Trabalhadores no início do mês i

$$t_i = t_{(i-1)} + c_i - d_i$$

Não negatividade

$$t_i, x_i, c_i, e_i, a_i \geq 0 \quad \forall i$$

Variáveis

- t_i trabalhadores
- x_i produção
- c_i contratados
- d_i demitidos
- e_i trab. extra
- a_i armazenados

Introdução à Otimização. INTRODUÇÃO II 10 / 17

Notas

Introdução Algoritmo Simplex Modelagem

Plan. Prod. - Função Objetivo

Mínimizando os Custos

$$\sum_{i=1}^{12} (2000t_i + 8a_i + 180e_i + 320c_i + 400d_i)$$

Variáveis

- t_i trabalhadores
- x_i produção
- c_i contratados
- d_i demitidos
- e_i trab. extra
- a_i armazenados

Introdução à Otimização. INTRODUÇÃO II 11 / 17

Notas

Introdução Algoritmo Simplex Modelagem

Modelagem - Análise de Investimentos

Um investidor tem 3 alternativas de investimento : A , B e C para o ano que se inicia. Os investimentos não são mutuamente exclusivos e o dinheiro proveniente de lucros em uma aplicação pode ser reinvestido novamente em qualquer uma das aplicações. As aplicações têm as seguintes características:

- A : disponível no início de cada um dos quatro trimestres; cada R\$ investido em A no princípio do trimestre devolve R\$ 1,10 no final do trimestre;
- B : disponível no início de cada um dos dois semestres; cada R\$ investido em B retorna R\$ 1,20 ao final do semestre.
- C : disponível somente no início do ano; Cada R\$ investido em C devolve R\$ 1,40 no final do ano.

O capital do investidor é de R\$ 5.000,00. Como maximizar o dinheiro acumulado pelo investidor até o final do ano ?

Introdução à Otimização. INTRODUÇÃO II 12 / 17

Notas

Carteira de Aplicações

Variáveis de Decisão

x_{ij} : quantidade investida na aplicação i no trimestre j

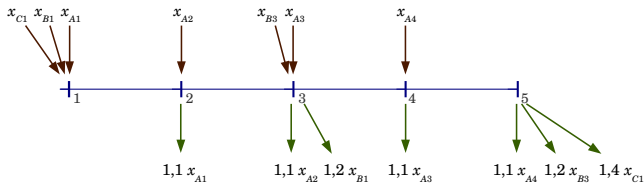


$$i \in \{A, B, C\}, j \in \{1, 2, 3, 4\}$$

$$x_{A1}, x_{A2}, x_{A3}, x_{A4}, x_{B1}, x_{B2}, x_{C1}$$

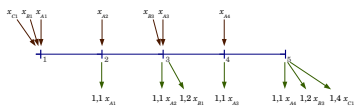
Notas

O Fluxo do Capital



Notas

O Fluxo do Capital : Função Objetivo



Maximize

$$1,1x_{A1} + 1,2x_{B3} + 1,4x_{C1}$$

(lembra-se que o dinheiro ganho em períodos anteriores pode ser reinvestido.)

Notas

O Fluxo do Capital : Restrições

Período 1

Os R\$ 5.000,00 disponíveis podem ser guardados ou investidos em A,B ou C.
Criaremos uma variável artificial g_1 que indica a quantidade guardada no período 1.

$$x_{A1} + x_{B1} + x_{C1} + g_1 = 5000$$

Período 2

$$x_{A2} + r_2 = 1, 1x_{A1} + g_1$$

Período n

investimentos em n + guardados em n
=
lucros em n + guardados em $n - 1$

Notas

Fluxo de Capital - Modelo

Maximize:

$$1, 1x_{A4} + 1, 2x_{B3} + 1, 4x_{C1}$$

Sujeito a:

$$x_{A1} + x_{B1} + x_{C1} + g_1 = 5000$$

$$x_{A2} + g_2 = g_1 + 1, 1x_{A1}$$

$$x_{A3} + x_{B3} + g_3 = g_2 + 1, 1x_{A2} + 1, 2x_{B1}$$

$$x_{A4} + g_4 = g_3 + 1, 1x_{A3}$$

$$x_{ij} \geq 0 \quad \forall i, j$$

$$g_j \geq 0 \quad \forall j$$

Notas

Notas
