

IFT 2505

Programmation Linéaire

Fabian Bastin
DIRO
Université de Montréal

<http://www.iro.umontreal.ca/~bastin/ift2505.php>

Automne 2013

Nous considérons le problème, dit **primal** :

$$\begin{aligned} & \min_x c^T x \\ & \text{t.q. } Ax \geq b \\ & \quad x \geq 0 \end{aligned}$$

Le programme suivant est appelé **dual** :

$$\begin{aligned} & \max_{\lambda} \lambda^T b \\ & \text{t.q. } A^T \lambda \leq c \\ & \quad \lambda \geq 0 \end{aligned}$$

$$A \in \mathcal{R}^{m \times n}, c, x \in \mathcal{R}^n, \lambda, b \in \mathcal{R}^m.$$

Note : les contraintes duales peuvent aussi s'écrire $\lambda^T A \leq c^T$ (en appliquant l'opérateur de transposition de part et d'autre de l'inégalité).

x : variables du problème primal

λ : variables du problèmes dual

Dual du dual ?

$$\min_x c^T x$$

$$\text{t.q. } Ax \geq b$$

$$x \geq 0$$

Dualité : forme standard

$$\begin{aligned} & \min_x c^T x \\ & \text{t.q. } Ax = b \\ & \quad x \geq 0 \end{aligned}$$

revient à

$$\begin{aligned} & \min_x c^T x \\ & \text{t.q. } Ax \geq b \\ & \quad -Ax \geq -b \\ & \quad x \geq 0 \end{aligned}$$

Dualité : forme standard

Le dual peut alors s'écrire

$$\max_{u,v} u^T b - v^T b$$

$$\text{t.q. } u^T A - v^T A \leq c^T$$

$$u \geq 0$$

$$v \geq 0$$

ou, avec $\lambda = u - v$,

$$\max_{\lambda} \lambda^T b$$

$$\text{t.q. } \lambda^T A \leq c^T$$

Forme asymétrique : $\lambda \in \mathcal{R}$.

Conversion primal-dual

Minimisation	Maximisation
Contraintes	Variables
\geq	≥ 0
\leq	≤ 0
$=$	non restreint
Variables	Contraintes
≥ 0	\leq
≤ 0	\geq
non restreint	$=$

Conversion primal-dual : exemples

Primal

Dual

$$\begin{aligned} \min_x \quad & c^T x \\ \text{t.q. } & Ax = b, \\ & x \geq 0. \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \max_{\lambda} \quad & b^T \lambda \\ \text{t.q. } & A^T \lambda \leq c. \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \min_x \quad & c^T x \\ \text{t.q. } & Ax \geq b, \\ & x \geq 0. \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \max_{\lambda} \quad & b^T \lambda \\ \text{t.q. } & A^T \lambda \leq c, \\ & \lambda \geq 0. \end{aligned}$$

Conversion primal-dual : exemples

$$\begin{aligned} \max_x & c^T x \\ \text{t.q. } & Ax = b, \\ & x \geq 0. \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \min_{\lambda} & b^T \lambda \\ \text{t.q. } & A^T \lambda \geq c. \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \min_x & c^T x \\ \text{t.q. } & Ax \leq b, \\ & x \geq 0. \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \max_{\lambda} & b^T \lambda \\ \text{t.q. } & A^T \lambda \leq c, \\ & \lambda \leq 0. \end{aligned}$$

Exemple : le problème de régime alimentaire

- x_j : unités de produit alimentaire
- n produits
- b : besoins minimums (b_i : i^e nutriment)
- c : coût
- m nutriments
- a_{ij} : unités de nutriments i dans le produit j .

Primal : on veut minimiser sa consommation tout en satisfaisant les besoins minimums

$$\begin{aligned} & \min_x c^T x \\ & \text{t.q. } Ax \geq b \\ & \quad x \geq 0 \end{aligned}$$

Exemple : le problème de régime alimentaire

Dual :

$$\begin{aligned} & \max_{\lambda} \lambda^T b \\ & \text{t.q. } \lambda^T A \leq c^T \\ & \quad \lambda \geq 0 \end{aligned}$$

λ pourrait par exemple représenter le prix de compléments alimentaires ; on veut maximiser le revenu de la vente de tels compléments.

La contrainte traduit qu'on doit rester compétitif : les prix des compléments doivent rester inférieurs au coût des aliments originaux.

Exemple

Considérons le problème

$$\min z = -4x_1 - 3x_2 - x_3 - 2x_4$$

$$\text{t.q. } 4x_1 + 2x_2 + x_3 + x_4 \leq 5$$

$$3x_1 + x_2 + 2x_3 + x_4 \leq 4$$

$$x_j \geq 0, \quad j = 1, \dots, 6.$$

Pour obtenir la forme standard, nous devons ajouter 2 variables d'écart, disons x_5 et x_6 . Ceci donne le problème

$$\min z = -4x_1 - 3x_2 - x_3 - 2x_4$$

$$\text{t.q. } 4x_1 + 2x_2 + x_3 + x_4 + x_5 = 5$$

$$3x_1 + x_2 + 2x_3 + x_4 + x_6 = 4$$

$$x_j \geq 0, \quad j = 1, \dots, 6.$$

Exemple

Sous forme tableau, ceci se traduit par

x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	x_6	b
4	2	1	1	1	0	5
3	1	2	1	0	1	4
-4	-3	-1	-2	0	0	0

Le système est déjà sous forme canonique, et nous pouvons identifier les variables de base x_5 et x_6 . A ce système correspondent

$$A = \begin{pmatrix} 4 & 2 & 1 & 1 & 1 & 0 \\ 3 & 1 & 2 & 1 & 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad b = \begin{pmatrix} 5 \\ 4 \end{pmatrix}$$

Plutôt que de devoir travailler sur toutes les colonnes de A en permanence, nous allons utiliser la version révisée du simplexe.

Exemple

Nous cherchons d'abord à calculer les coûts réduits, en notant que

$$B = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}, \quad B^{-1} = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Nous avons

$$\lambda^T = c_B^T B^{-1} = (0 \ 0) B^{-1} = (0 \ 0)$$

Dès lors,

$$r_D^T = c_D^T - \lambda^T D = c_D^T = (-4 \ -3 \ -1 \ -2)$$

Il existe des coûts réduits négatifs, aussi nous n'avons pas terminé.

Une possibilité est de faire entre x_1 .

Exemple

Dans la base courante,

$$y_1 = B^{-1}a_1 = \begin{pmatrix} 4 \\ 3 \end{pmatrix}$$

Le pivotage peut se résumer à

	x_5	x_6	b	y_1
x_5	1	0	5	4
x_6	0	1	4	3
$-z$	0	0	0	-4

Le minimum des rapports compasante pas compasante entre b et y_1 , pour les éléments strictement positifs de y_1 , est $5/4$. Autrement dit, x_1 entre dans la base et x_5 sort. La réduction du tableau donne

	x_5	x_6	b	y_1
x_1	$1/4$	0	$5/4$	1
x_6	$-3/4$	1	$1/4$	0
$-z$	1	0	5	0

Exemple

Du tableau précédent, nous tirons

$$B^{-1} = \begin{pmatrix} 1/4 & 0 \\ -3/4 & 1 \end{pmatrix}$$

et en conséquence

$$\lambda^T = (-4 \ 0) \begin{pmatrix} 1/4 & 0 \\ -3/4 & 1 \end{pmatrix} = (-1 \ 0)$$

Les coûts réduits deviennent

$$\begin{aligned} r_D^T &= (-3 \ -1 \ -2 \ 0) - (-1 \ 0) \begin{pmatrix} 2 & 1 & 1 & 1 \\ 1 & 2 & 1 & 0 \end{pmatrix} \\ &= (-3 \ -1 \ -2 \ 0) + (2 \ 1 \ 1 \ 1) \\ &= (-1 \ 0 \ -1 \ 1) \end{aligned}$$

Exemple

Il a des coûts réduits strictement négatifs, aussi on doit continuer.
On choisit ici le premier coût, autrement dit on fait entrée x_2 ,
lequel est associé à

$$y_2 = B^{-1}a_2 = \begin{pmatrix} 1/4 & 0 \\ -3/4 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1/2 \\ -1/2 \end{pmatrix}$$

Procérons au pivotage :

$$\begin{array}{rcccc} & x_5 & x_6 & b & y_2 \\ x_1 & 1/4 & 0 & 5/4 & 1/2 \\ x_6 & -3/4 & 1 & 1/4 & -1/2 \\ -z & 1 & 0 & 5 & -1 \end{array}$$

$$\begin{array}{rcccc} & x_5 & x_6 & b & y_2 \\ x_2 & 1/2 & 0 & 5/2 & 1 \\ x_6 & -1/2 & 1 & 3/2 & 0 \\ -z & 3/2 & 0 & 15/2 & 0 \end{array}$$

Exemple

Nous obtenons

$$B^{-1} = \begin{pmatrix} 1/2 & 0 \\ -1/2 & 1 \end{pmatrix}$$

et donc

$$\lambda^T = (-3 \ 0) \begin{pmatrix} 1/2 & 0 \\ -1/2 & 1 \end{pmatrix} = (-3/2 \ 0)$$

Les coûts réduits valent

$$\begin{aligned} r_D^T &= (-4 \ -1 \ -2 \ 0) - (-3/2 \ 0) \begin{pmatrix} 4 & 1 & 1 & 1 \\ 3 & 2 & 1 & 0 \end{pmatrix} \\ &= (-4 \ -1 \ -2 \ 0) + (6 \ 3/2 \ 3/2 \ 3/2) \\ &= (2 \ 1/2 \ -1/2 \ 3/2) \end{aligned}$$

La variable d'entrée doit être x_4 .

Exemple

Nous avons

$$y_4 = \begin{pmatrix} 1/2 & 0 \\ -1/2 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1/2 \\ 1/2 \end{pmatrix}$$

Cela conduit au tableau

	x_5	x_6	b	y_2
x_2	1/2	0	5/2	1/2
x_6	-1/2	1	3/2	1/2
$-z$	3/2	0	15/2	-1/2

et x_6 doit sortir de la base. Le pivotage conduit à

	x_5	x_6	b	y_2
x_2	1	-1	1	0
x_4	-1	2	3	1
$-z$	1	1	9	0

Exemple

Dès lors

$$B^{-1} = \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ -1 & 2 \end{pmatrix},$$

$$\lambda^T = (-3 \quad -2) \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ -1 & 2 \end{pmatrix} = (-1 \quad -1)$$

Les coûts réduits sont

$$\begin{aligned} r_D^T &= (-4 \quad -1 \quad 0 \quad 0) - (-1 \quad -1) \begin{pmatrix} 4 & 1 & 1 & 0 \\ 3 & 2 & 0 & 1 \end{pmatrix} \\ &= (-4 \quad -1 \quad 0 \quad 0) + (7 \quad 3 \quad 1 \quad 1) \\ &= (3 \quad 2 \quad 1 \quad 1) \end{aligned}$$

Tous les coûts réduits sont positifs. La base B_3 est donc optimale.

La solution associée à B_3 est

$$(0 \quad 1 \quad 0 \quad 3 \quad 0 \quad 0)$$

pour une valeur optimale de -9.

Exemple : dual

Reprendons le problème primal.

$$\min z = -4x_1 - 3x_2 - x_3 - 2x_4$$

$$\text{t.q. } 4x_1 + 2x_2 + x_3 + x_4 \leq 5$$

$$3x_1 + x_2 + 2x_3 + x_4 \leq 4$$

$$x_j \geq 0, j = 1, \dots, 6.$$

Formons le dual

$$\max 5\lambda_1 + 4\lambda_2$$

$$\text{t.q. } 4\lambda_1 + 3\lambda_2 \leq -4$$

$$2\lambda_1 + \lambda_2 \leq -3$$

$$\lambda_1 + 2\lambda_2 \leq -1$$

$$\lambda_1 + \lambda_2 \leq -2$$

$$\lambda_1 \leq 0, \lambda_2 \leq 0.$$

Exemple : dual

Essayons de nous rapprocher de la forme standard :

$$\begin{aligned} & -\min \quad -5\lambda_1 - 4\lambda_2 \\ \text{t.q. } & -4\lambda_1 - 3\lambda_2 \geq 4 \\ & 2\lambda_1 - \lambda_2 \geq 3 \\ & -\lambda_1 - 2\lambda_2 \geq 1 \\ & -\lambda_1 - \lambda_2 \geq 2 \\ & -\lambda_1 \geq 0, -\lambda_2 \geq 0. \end{aligned}$$

Exemple : dual

On posant $y_i = -\lambda_i$, en ajoutant des variables de surplus, et en oubliant temporairement le signe négatif devant l'opérateur de minimisation, nous avons

$$\min 5y_1 + 4y_2$$

$$\text{t.q. } 4y_1 + 3y_2 - y_3 = 4$$

$$2y_1 + y_2 - y_4 = 3$$

$$y_1 + 2y_2 - y_5 = 1$$

$$y_1 + y_2 - y_6 = 2$$

$$y_1 \geq 0, y_2 \geq 0.$$

$$y_3 \geq 0, y_4 \geq 0, y_5 \geq 0, y_6 \geq 0.$$

En résolvant ce problème (avec par exemple une méthode à deux phases), nous obtenons la solution optimale

$$y^* = (1 \ 1 \ 0 \ 0 \ 0 \ 0)$$

pour la valeur optimale 9.

Exemple : dual

En repassant au dual original, cela donne une valeur optimale de -9 et

$$\lambda^* = (-1 \quad -1)$$

comme lors du dernier calcul dans le simplexe révisé pour le primal.

Est-ce un hasard ? Pas vraiment . . .

(Forme symétrique ou forme asymétrique – forme standard)

Si x and λ sont réalisables pour le primal et le dual, respectivement, alors

$$c^T x \geq \lambda^T b$$

Démonstration.

$$\lambda^T b \leq \lambda^T A x \leq c^T x,$$

pour $x \geq 0$, vu que x est supposé réalisable, et que du dual, $\lambda^T A \leq c^T$. □

Dès lors, l'objectif primal est une borne supérieure pour le dual, et vice-versa.

Corollaire

Si x_0 et λ_0 sont réalisables pour le primal et le dual, respectivement, et si

$$c^T x_0 = \lambda_0^T b,$$

alors x_0 et λ_0 sont optimaux pour leur problème respectif.

Mais on n'a encore dit sur la réalisabilité d'un problème par rapport à l'autre !

Dualité forte

Si un des problèmes, primal ou dual, a une solution optimale finie, l'autre problème a aussi une solution optimale finie, et les valeurs correspondantes des fonctions objectifs sont égales. Si l'un des problèmes a un objectif non borné, l'autre problème n'a pas de solution réalisable.

Démonstration.

La deuxième affirmation est une conséquence directe du lemme.

Ainsi si le primal est non borné et λ est réalisable pour le dual, nous devons avoir

$$\lambda^T b \leq -M$$

pour M arbitrairement grand, ce qui est impossible.



Démonstration.

Si le primal a une solution optimale finie, nous voulons montrer que le dual a une solution optimale finie.

Soit z_0 la valeur optimale du primal. Définissons

$$C = \{(r, w) : r = tz_0 - c^T x, \\ w = tb - Ax, x \geq 0, t \geq 0\}$$

C est un cône convexe fermé.

Mais $(1, 0) \notin C$.

Par l'absurde, supposons $(1, 0) \in C$.



Démonstration.

Si $w = t_0 b - Ax_0 = 0$, $t_0 > 0$, $x_0 \geq 0$, alors $x = x_0/t_0$ est réalisable pour le primal comme $Ax = b$.

Dès lors $r/t_0 = z_0 - c^T x \leq 0$, et donc $r \leq 0$, alors qu'on supposait $r = 1$.

Si $w = Ax_0 = 0$ ($t_0 = 0$), $x_0 \geq 0$, de $r = tz_0 - c^T x_0$, nous avons $c^T x_0 = -1$.

Si x est réalisable pour le primal, alors $x + \alpha x_0$ est réalisable pour tout α . Dès lors, $c^T(x + \alpha x_0)$ peut être diminué à l'infini, en augmentant α . Ceci contredit l'existence d'un minimum fini.

Donc, $(1, 0) \notin C$.



Démonstration.

Comme C est un ensemble convexe fermé, cela implique qu'il existe un hyperplan séparant $(1, 0)$ et C .

Dès lors, $\exists [s, \lambda] \in \mathcal{R}^{m+1}$, $[s, \lambda] \neq 0$, et une constante k t.q.

$$\begin{aligned}s = (s, \lambda)^T (1, 0) &< \inf\{(s, \lambda)^T (r, w) \text{ t.q. } (r, w) \in C\} \\&= \inf\{s^T r + \lambda^T w \text{ t.q. } (r, w) \in C\} = k\end{aligned}$$

Comme C est un cône, $k \geq 0$. En effet, si $k < 0$, $\exists (r, w) \in C$ t.q. $s r + \lambda^T w < 0$, et pour α assez grand, $\alpha(r, w)$ violerait l'inégalité de l'hyperplan.

Mais $(0, 0) \in C$, donc $k \leq 0$, et de là, $k = 0$, et $s < 0$.



Démonstration.

S.p.d.g. $s = -1$ (vu que $(1, 0) \notin C$ implique $(\beta, 0) \notin C$, $\beta > 0$, car C est un cône).

Ainsi, $\exists \lambda \in \mathbb{R}^m$ t.q.

$$-r + \lambda^T w \geq 0, \quad \forall (r, w) \in C.$$

De manière équivalente, par définition de C ,

$$(c - \lambda^T A)x - tz_0 + t\lambda^T b \geq 0, \quad \forall x, t \geq 0.$$

$t = 0$ donne $\lambda^T A \leq c^T$, i.e. λ est réalisable pour le dual.

$x = 0$ et $t = 1$ donne $\lambda^T b \geq z_0$. Par le lemme 1 et son corollaire, λ est optimal pour le dual. □

Démonstration.

Comme le dual du dual est le primal, la preuve est complète. □