

ソルバーの中身を理解する(1)

Relaxation and Duality
問題の緩和と双対



ここで学ぶこと

- 最適化問題の最適値の上限・下限
- 最適化問題が持つ裏の顔と表との関係



例題1 生産計画

- 2つの製品Q,Rを製造
- 製品Q,R共, 原液A,Bから生産
- 利益最大の生産計画は?



	製品Q 1kg当たり	製品R 1kg当たり	使用可能量
原液A	2(kl)	1(kl)	70(kl/日)
原液B	3(kl)	4(kl)	180(kl/日)
利益	6(千円)	4(千円)	

定式化してみよう!

定式化

製品Qの製造量を x_1 、製品Rの製造量を x_2 とおく。

$$\begin{aligned} \max & 6x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} & 2x_1 + x_2 \leq 70 \quad \dots \\ & 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \quad \dots \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

最適値はどの程度？
見積もってみよう



見積もり例

制約式 $\times 2$ + 制約式 $\times 1$: $7x_1 + 6x_2$ $70 \times 2 + 180 = 320$

目的関数: $6x_1 + 4x_2$ x_1, x_2 0より

⇒ 最適値の**上界**は**320**

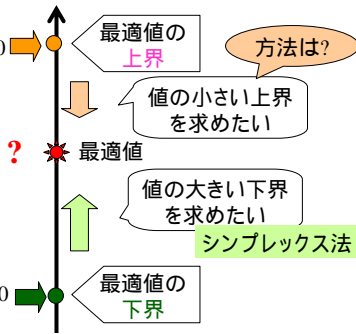
演習1: もっと良い見積もりをしてみよう

最適値の上界・下界

前ページの見積もり 320

$$\begin{aligned} \max & 6x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} & 2x_1 + x_2 \leq 70 \\ & 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

実行可能解
 $x_1=10, x_2=30$
(目的関数値) = 180



より良い上界の見積もり方法

各制約式を何倍するのが適切かを考える

制約式 $\times y_1$ + 制約式 $\times y_2$: $(2x_1 + x_2) \times y_1 + (3x_1 + 4x_2) \times y_2$ $70y_1 + 180y_2$

小さくしたい

$$\left\{ \begin{aligned} (2y_1 + 3y_2) \times x_1 + (y_1 + 4y_2) \times x_2 \\ \text{目的関数: } 6x_1 + 5x_2 \end{aligned} \right.$$

$$\begin{aligned} 2y_1 + 3y_2 & \geq 6 \\ y_1 + 4y_2 & \geq 5 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \min. & 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} & 2y_1 + 3y_2 \geq 6 \\ & y_1 + 4y_2 \geq 5 \\ & y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

この問題の最適解が
最良の上界を与える

演習2

次の問題の最適値のより良い下界を求める
線形計画問題を作ってみよう

$$\begin{array}{ll}
 \min & 70y_1 + 180y_2 \\
 \text{s.t.} & 2y_1 + 3y_2 \geq 6 \\
 & y_1 + 4y_2 \geq 4 \\
 & y_1, y_2 \geq 0
 \end{array}$$

どのような線形計画問題が得られるか？

双対な関係

問題(P)		問題(D)
$ \begin{array}{ll} \max & 6x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} & 2x_1 + x_2 \leq 70 \\ & 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{array} $	\rightleftarrows	$ \begin{array}{ll} \min & 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} & 2y_1 + 3y_2 \geq 6 \\ & y_1 + 4y_2 \geq 4 \\ & y_1, y_2 \geq 0 \end{array} $

主問題 \longrightarrow 双対問題
双対問題 \longleftarrow 主問題

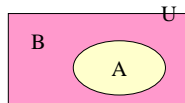
「双対(そうつい)」とは

- あるAに、ある操作を行ったら、Bを得た。
- Bに、操作を行ったら、Aを得た。



AとBは(操作に関し)双対の関係

- (例) 集合Uの部分集合A:
集合Aの補集合を集合Bとする。
集合Bの補集合は集合A。



集合Aと集合Bは(補集合という操作に関し)双対。

面白そうな双対の関係

- (射影)幾何学の分野:点と線は双対.
 - 定理「2点を通る直線は1つ」
 - 定理「2直線を通る点」は1つ」
 } 双対性 (duality)
- いろいろな数理的な場面で双対の関係が本質的に重要役割を演じることが多い.
- 線形計画(数理計画)の分野にも...

演習3 双対問題を作ろう

$$\begin{aligned}
 &\text{maximize } z = -x_1 + 2x_2 \\
 &\text{subject to } 2x_1 + x_2 \geq 8 \quad \dots \\
 &\quad \quad \quad x_1 + 3x_2 + x_3 = 9 \quad \dots \\
 &\quad \quad \quad x_1, x_2, x_3 \geq 0
 \end{aligned}$$

双対問題を作る別な方法

(P)

$$\begin{aligned}
 &\max \quad 6x_1 + 4x_2 \\
 &\text{s.t.} \quad 2x_1 + x_2 \leq 70 \\
 &\quad \quad 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\
 &\quad \quad x_1, x_2 \geq 0
 \end{aligned}$$

$70 - (2x_1 + x_2) \geq 0$ $y_1 \geq 0$ に対して $y_1(70 - (2x_1 + x_2)) \geq 0$
 $180 - (3x_1 + 4x_2) \geq 0$ $y_2 \geq 0$ に対して $y_2(180 - (3x_1 + 4x_2)) \geq 0$

(P1)

$$\begin{aligned}
 &\max \quad 6x_1 + 4x_2 + y_1(70 - (2x_1 + x_2)) + y_2(180 - (3x_1 + 4x_2)) \\
 &\text{s.t.} \quad 2x_1 + x_2 \leq 70 \quad \text{非負} \quad \text{非負} \\
 &\quad \quad 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\
 &\quad \quad x_1, x_2 \geq 0
 \end{aligned}$$

ラグランジュ緩和

(P1)

$$\begin{aligned} \max \quad & 6x_1 + 4x_2 + y_1(70 - (2x_1 + x_2)) + y_2(180 - (3x_1 + 4x_2)) \\ \text{s.t.} \quad & 2x_1 + x_2 \leq 70 \\ & 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \\ & y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

最適化では
様々な場面で現れる
重要な緩和手法

(P2) ↓ ラグランジュ緩和(Lagrange Relaxation)

$$\begin{aligned} \max \quad & 6x_1 + 4x_2 + y_1(70 - (2x_1 + x_2)) + y_2(180 - (3x_1 + 4x_2)) \\ \text{s.t.} \quad & x_1, x_2 \geq 0, \quad y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

ラグランジュ緩和問題

ラグランジュ緩和問題の構造

ラグランジュ緩和問題

$$\begin{aligned} \max \quad & 6x_1 + 4x_2 + y_1(70 - (2x_1 + x_2)) + y_2(180 - (3x_1 + 4x_2)) \\ \text{s.t.} \quad & x_1, x_2 \geq 0, \quad y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

ラグランジュ緩和問題

整理

非有界にならないための条件

$$\begin{aligned} & 6 - 2y_1 - 3y_2 \leq 0 \\ & 4 - y_1 - 4y_2 \leq 0 \end{aligned}$$

条件緩和
目的関数に追加

(P2)の最適値
(P1)の最適値
(P)の最適値

$$\begin{aligned} \max \quad & (6 - 2y_1 - 3y_2)x_1 + (4 - y_1 - 4y_2)x_2 + 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} \quad & x_1, x_2 \geq 0, \quad y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

ラグランジュ緩和問題を利用した より良い上界の導出

小さくしたい

$$\begin{aligned} \max \quad & (6 - 2y_1 - 3y_2)x_1 + (4 - y_1 - 4y_2)x_2 + 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} \quad & x_1, x_2 \geq 0, \quad y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

より良い上界を求める問題(D)

$$\begin{aligned} \min \quad & 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} \quad & 6 - 2y_1 - 3y_2 \leq 0 \\ & 4 - y_1 - 4y_2 \leq 0 \\ & y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

ラグランジュ緩和問題
(P2)の最適値
(P1)の最適値
(P)の最適値

ラグランジュ緩和問題を利用した 双対問題の導出

<p>(P)</p> $\begin{aligned} \max \quad & 6x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} \quad & 2x_1 + x_2 \leq 70 \\ & 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$	\longleftrightarrow 双対	<p>(D)</p> $\begin{aligned} \min. \quad & 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} \quad & 2y_1 + 3y_2 \geq 6 \\ & y_1 + 4y_2 \geq 4 \\ & y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$
--	-----------------------------	---

ラグランジュ緩和問題

(P2)の最適値



(D)の最適値



(P)の最適値



より良いPの上界

練習 ラグランジュ緩和問題を経由し 双対問題を作ろう

$$\begin{aligned} \text{maximize} \quad & z = -x_1 + 2x_2 \\ \text{subject to} \quad & 2x_1 + x_2 \geq 8 \quad \dots \\ & x_1 + 3x_2 + x_3 = 9 \quad \dots \\ & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \end{aligned}$$

練習 解答例(1)

<p>(P)</p> $\begin{aligned} \max. \quad & -x_1 + 2x_2 \\ \text{s.t.} \quad & 2x_1 + x_2 \geq 8 \\ & x_1 + 3x_2 + x_3 = 9 \\ & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \end{aligned}$	$8 - (2x_1 + x_2) = 0$	0	y_1 0に対して $y_1(8 - (2x_1 + x_2)) = 0$	
$9 - (x_1 + 3x_2 + x_3) = 0$	y_2 (自由変数) に対して $y_2(9 - (x_1 + 3x_2 + x_3)) = 0$			

(P1)

$$\begin{aligned} \max. \quad & -x_1 + 2x_2 + y_1(8 - (2x_1 + x_2)) + y_2(9 - (x_1 + 3x_2 + x_3)) \\ \text{s.t.} \quad & 2x_1 + x_2 \geq 8 \quad \text{非負} \\ & x_1 + 3x_2 + x_3 = 9 \quad \text{0} \\ & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \\ & y_1 \leq 0 \\ & y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

練習 解答例(2)

(P1)

$$\begin{aligned} \max. & -x_1 + 2x_2 + y_1(8 - (2x_1 + x_2)) + y_2(9 - (x_1 + 3x_2 + x_3)) \\ \text{s.t.} & 2x_1 + x_2 \geq 8 \\ & x_1 + 3x_2 + x_3 = 9 \\ & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \\ & y_1 \leq 0 \end{aligned}$$

(P2)  ラグランジュ緩和(Lagrange Relaxation)


$$\begin{aligned} \max. & -x_1 + 2x_2 + y_1(8 - (2x_1 + x_2)) + y_2(9 - (x_1 + 3x_2 + x_3)) \\ \text{s.t.} & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \\ & y_1 \leq 0 \end{aligned}$$

ラグランジュ緩和問題

練習 解答例(3)

ラグランジュ緩和問題

$$\begin{aligned} \max. & -x_1 + 2x_2 + y_1(8 - (2x_1 + x_2)) + y_2(9 - (x_1 + 3x_2 + x_3)) \\ \text{s.t.} & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \\ & y_1 \leq 0 \end{aligned}$$

整理  非有界にならないための条件

$$\begin{aligned} & -1 - 2y_1 - y_2 \leq 0 \\ & 2 - y_1 - 3y_2 \leq 0 \\ & -y_2 \leq 0 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \max. & (-1 - 2y_1 - y_2)x_1 + (2 - y_1 - 3y_2)x_2 + (-y_2)x_3 + 8y_1 + 9y_2 \\ \text{s.t.} & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \\ & y_1 \leq 0 \end{aligned}$$

練習 解答例(4)

$$\begin{aligned} & -1 - 2y_1 - y_2 \leq 0 \\ & 2 - y_1 - 3y_2 \leq 0 \\ & -y_2 \leq 0 \end{aligned}$$

小さくしたい

$$\begin{aligned} \max. & (-1 - 2y_1 - y_2)x_1 + (2 - y_1 - 3y_2)x_2 + (-y_2)x_3 + 8y_1 + 9y_2 \\ \text{s.t.} & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \\ & y_1 \leq 0 \end{aligned}$$

ラグランジュ緩和問題

(P2)の最適値 

(P1)の最適値 

(P)の最適値 

より良い上界

より良い上界を
求める問題(D)

$$\begin{aligned} \min. & 8y_1 + 9y_2 \\ \text{s.t.} & -1 - 2y_1 - y_2 \leq 0 \\ & 2 - y_1 - 3y_2 \leq 0 \\ & -y_2 \leq 0 \\ & y_1 \leq 0 \end{aligned}$$

練習 解答例(5)

<p>(P)</p> <div style="border: 1px solid green; padding: 5px; width: fit-content;"> $\begin{aligned} \max. & -x_1 + 2x_2 \\ \text{s.t.} & 2x_1 + x_2 \geq 8 \\ & x_1 + 3x_2 + x_3 = 9 \\ & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \end{aligned}$ </div>	<p>双対</p>	<p>(D)</p> <div style="border: 1px solid blue; padding: 5px; width: fit-content;"> $\begin{aligned} \min. & 8y_1 + 9y_2 \\ \text{s.t.} & 2y_1 + y_2 \geq -1 \\ & y_1 + 3y_2 \geq 2 \\ & y_1 \leq 0 \\ & y_2 \geq 0 \end{aligned}$ </div>
--	-----------	---

ラグランジュ緩和問題

(P2)の最適値



(D)の最適値



(P)の最適値



より良いPの上界

演習4

ラグランジュ緩和問題を經由し、
(D)の双対問題が(P)になることを確認せよ

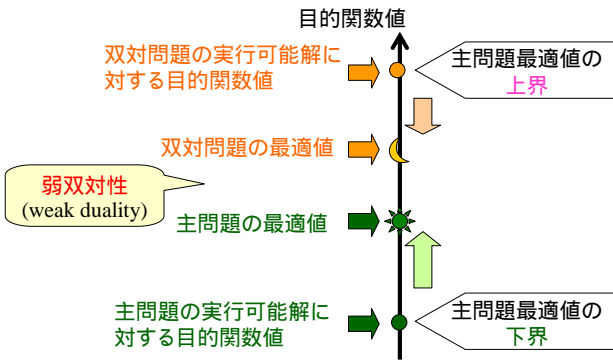
<p>(D)</p> <div style="border: 1px solid blue; padding: 5px; width: fit-content;"> $\begin{aligned} \min. & 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} & 2y_1 + 3y_2 \geq 6 \\ & y_1 + 4y_2 \geq 4 \\ & y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$ </div>		<p>(P)</p> <div style="border: 1px solid green; padding: 5px; width: fit-content;"> $\begin{aligned} \max. & 6x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} & 2x_1 + x_2 \leq 70 \\ & 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$ </div>
---	--	--

演習5

ラグランジュ緩和問題を經由し、
(D)の双対問題が(P)になることを確認せよ

<p>(D)</p> <div style="border: 1px solid blue; padding: 5px; width: fit-content;"> $\begin{aligned} \min. & 8y_1 + 9y_2 \\ \text{s.t.} & 2y_1 + y_2 \geq -1 \\ & y_1 + 3y_2 \geq 2 \\ & y_1 \leq 0 \\ & y_2 \geq 0 \end{aligned}$ </div>		<p>(P)</p> <div style="border: 1px solid green; padding: 5px; width: fit-content;"> $\begin{aligned} \max. & -x_1 + 2x_2 \\ \text{s.t.} & 2x_1 + x_2 \geq 8 \\ & x_1 + 3x_2 + x_3 = 9 \\ & x_1, x_2, x_3 \geq 0 \end{aligned}$ </div>
---	--	--

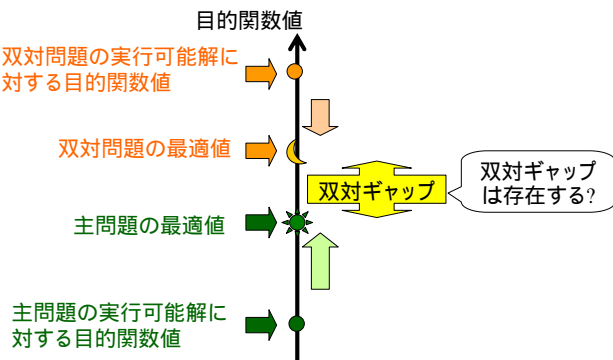
主問題と双対問題の関係(1)



主問題と双対問題の関係(2)

どの組合せ があり得る?		双対問題		
		実行可能 最適解	非 有界	実行 不能
主 問 題	実行 可能	😊	×	×
	非 有界	×	×	😊
	実行 不能	×	😊	😊

主問題と双対問題の関係(3)



主問題と双対問題の解

シンプレックス法で最適解と最適値を求めてみる

主問題(P)

$$\begin{aligned} \max \quad & 6x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} \quad & 2x_1 + x_2 \leq 70 \\ & 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

双対問題(D)

$$\begin{aligned} \min \quad & 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} \quad & 2y_1 + 3y_2 \geq 6 \\ & y_1 + 4y_2 \geq 4 \\ & y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

各々の最終的なシンプレックス表を比較

主問題

製品Qの製造量: x_1

製品Rの製造量: x_2

$$\begin{aligned} \max \quad & 6x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} \quad & 2x_1 + x_2 \leq 70 \\ & 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$



シンプレックス法で解く

シンプレックス表
(最終)

基底変数	z	x1	x2	s1	s2	定数項
x1	0	1	0	4/5	-2/5	20
x2	0	0	1	-3/5	2/5	30
z	1	0	0	12/5	2/5	240

最適解 $x_1 = 20, x_2 = 30$

双対問題

$$\begin{aligned} \min \quad & 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} \quad & 2y_1 + 3y_2 \geq 6 \\ & y_1 + 4y_2 \geq 4 \\ & y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$



$$\begin{aligned} \max \quad & (-z) = -70y_1 - 180y_2 \\ \text{s.t.} \quad & 2y_1 + 3y_2 - s_1 = 6 \\ & y_1 + 4y_2 - s_2 = 5 \\ & y_1, y_2, s_1, s_2 \geq 0 \end{aligned}$$

2段階シンプレックス表(最終)

基底変数	(-z)	y1	y2	s1	s2	定数項
y1	0	1	0	-4/5	3/5	12/5
y2	0	0	1	1/5	-2/5	2/5
(-z)	-1	0	0	20	30	240



比較

主問題

max	$6x_1 + 4x_2$	基底変数	z	x1	x2	s1	s2	定数項
s.t.	$2x_1 + x_2 \leq 70$	x1	0	1	0	4/5	-2/5	20
	$3x_1 + 4x_2 \leq 180$	x2	0	0	1	-3/5	2/5	30
	$x_1, x_2 \geq 0$	z	1	0	0	12/5	2/5	240

双対問題

min	$70y_1 + 180y_2$	基底変数	(-z)	y1	y2	s1	s2	定数項
s.t.	$2y_1 + 3y_2 \geq 6$	y1	0	1	0	-4/5	3/5	12/5
	$y_1 + 4y_2 \geq 4$	y2	0	0	1	1/5	-2/5	2/5
	$y_1, y_2 \geq 0$	(-z)	1	0	0	20	30	-240

主問題の最適値 双対問題の最適値 } 偶然?
 主(双対)問題の最適解 双対(主)問題の限界値

主問題

$$\begin{aligned} \max. & \mathbf{c}^T \mathbf{x} \\ \text{s.t.} & \mathbf{Ax} \leq \mathbf{b} \\ & \mathbf{x} \geq \mathbf{0} \end{aligned}$$



双対問題

$$\begin{aligned} \min. & \mathbf{b}^T \mathbf{y} \\ \text{s.t.} & \mathbf{A}^T \mathbf{y} \geq \mathbf{c} \\ & \mathbf{y} \geq \mathbf{0} \end{aligned}$$

LPでの主問題と双対問題の重要な関係
 ◆(主問題の最適値) = (双対問題の最適値)

(双対ギャップ) = 0

強双対性 (strong duality)

強双対性から得られる性質

$$\begin{aligned} \max. & (70 - 2x_1 - x_2)y_1 + (180 - 3x_1 - 4x_2)y_2 + 6x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} & x_1, x_2 \geq 0, y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

$$(70 - 2x_1 - x_2)y_1 + (180 - 3x_1 - 4x_2)y_2 = 0$$

(P)
$$\begin{aligned} \max & 6x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} & 2x_1 + x_2 \leq 70 \\ & 3x_1 + 4x_2 \leq 180 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

強双対性
 双対ギャップ = 0
 相補性条件

(D)
$$\begin{aligned} \min & 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} & 2y_1 + 3y_2 \geq 6 \\ & y_1 + 4y_2 \geq 4 \\ & y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

$$(6 - 2y_1 - 3y_2)x_1 + (4 - y_1 - 4y_2)x_2 = 0$$

$$\begin{aligned} \max & (6 - 2y_1 - 3y_2)x_1 + (4 - y_1 - 4y_2)x_2 + 70y_1 + 180y_2 \\ \text{s.t.} & x_1, x_2 \geq 0, y_1, y_2 \geq 0 \end{aligned}$$

ラグランジュ緩和問題

相補性条件

(Complementary slackness condition)

x_1, x_2 が(P)の実行可能解, y_1, y_2 が(D)の実行可能解

$$(70 - 2x_1 - x_2)y_1 + (180 - 3x_1 - 4x_2)y_2 = 0$$

$$(6 - 2y_1 - 3y_2)x_1 + (4 - y_1 - 4y_2)x_2 = 0$$

$$\begin{aligned} (70 - 2x_1 - x_2)y_1 &= 0 \\ (180 - 3x_1 - 4x_2)y_2 &= 0 \\ (6 - 2y_1 - 3y_2)x_1 &= 0 \\ (4 - y_1 - 4y_2)x_2 &= 0 \end{aligned}$$

条件に余裕
対応双対変数 = 0

x_1, x_2 が(P)の最適解

y_1, y_2 が(D)の最適解

双対定理

- 主問題に有界な最適解が存在
 - ⇕
 - 双対問題にも有界な最適解が存在
 - それぞれの目的関数値は一致
- ↪ 相補性条件
- ⇓
- 双対問題が主問題の最適解の証拠を提供
 - 双対問題から間接的に主問題の情報が得られる
 - 最適化アルゴリズムの開発に応用



演習6

以下の線形計画問題を解きなさい。

$$\begin{aligned} (1) \quad & \min 10x_1 + 20x_2 + 30x_3 & (2) \quad & \min 30x_1 + 10x_2 \\ \text{s.t.} \quad & 2x_1 + x_2 + 3x_3 \geq 4 & \text{s.t.} \quad & x_1 + x_2 \geq 4 \\ & x_1 + 2x_2 + 4x_3 \geq 5 & & 5x_1 + x_2 \geq 5 \\ & x_1, x_2, x_3 \geq 0 & & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

双対問題を作り, 双対定理を利用することにより
上記の問題を解きなさい

演習7

製品P,Q,Rは職人A,Bの手作業で完成する。

(例:製品Pは,職人Aが3時間,職人Bが2時間加工し完成)

- (1) 利益を最大にする生産計画を求める問題を定式化せよ。
- (2) 双対問題を作成せよ。
- (3) 双対変数の意味を自由に発想し解釈せよ。

	製品P 1個	製品Q 1個	製品R 1個	労働制限
職人A	3時間	2時間	4時間	40時間/週
職人B	2時間	4時間	3時間	42時間/週
利益	8千円	7千円	10千円	

さて,この後は

- **双対定理**を利用したアルゴリズム開発法
 - ネットワーク計画
- **緩和**を用いたアルゴリズムの開発法
 - 整数計画問題