

知の探究

4. 線形計画法

堀田 敬介

線形計画問題とは？

- 線形計画問題(Linear Programming Problem)
 - 線形(1次)等式・不等式系であらわされる条件のもとで、線形(1次)の目的関数を最大・最小化する形式の最適化問題

min.	$2x_1 + x_2 + 2x_3 + x_4 + 3x_5$	目的関数 objective function
s.t.	$x_1 + 2x_3 + x_5 \geq 5$	
	$9x_1 + 2x_2 + x_4 + 4x_5 \geq 1$	
	$x_2 + 5x_3 + x_5 \geq 3$	
	$x_2 + 5x_3 + x_5 \geq 2$	制約条件 constraints
	$x_1, x_2, x_3, x_4, x_5 \geq 0$	非負条件 nonnegativity

- 線形計画問題を解くための主な手法 algorithm
 - 単体法 simplex method, G.B.Dantzig(1947)
 - 内点法 interior point method, N.Karmarkar (1984)
 - (楕円体法 ellipsoid method, Yudin, A.S.Nemirovskii(1976), Khachiyan(1979))

線形計画問題とは？

- 線形計画問題を Excel Solver で解く

$$\min. 2x_1 + x_2 + 2x_3 + x_4 + 3x_5$$

$$\text{s.t.} \quad x_1 + 2x_3 + x_5 \geq 5$$

$$9x_1 + 2x_2 + x_4 + 4x_5 \geq 1$$

$$x_2 + 5x_3 + x_5 \geq 3$$

$$x_1 + 3x_3 + x_5 \geq 2$$

$$x_1, x_2, x_3, x_4, x_5 \geq 0$$

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P
1	1. LP を解く															
2			x_1	x_2	x_3	x_4	x_5									
3																
4									<i>obj. fn</i>				数式			
5		min	2	1	2	1	3	=	0				[I5] = SUMPRODUCT(C\$3:G\$3, C5:G5)			
6		s.t.	1	0	2	0	1	=	0	≧	5		↓			
7			9	2	0	1	4	=	0	≧	1		[I6]～[I9]へコピー			
8			0	1	5	0	1	=	0	≧	3		↓			
9			1	0	3	0	1	=	0	≧	2		↓			
10									<i>LHS</i>		<i>RHS</i>					

線形計画問題とは？

- 線形計画問題を Excel Solver で解く

	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q	R	S	T
1	解く																		
2		x_1	x_2	x_3	x_4	x_5													
3																			
4								<i>obj. fn</i>											
5	min	2	1	2	1	3	=	0											
6	s.t.	1	0	2	0	1	=	0	≡	5									
7		9	2	0	1	4	=	0	≡	1									
8		0	1	5	0	1	=	0	≡	3									
9		1	0	3	0	1	=	0	≡	2									
10								<i>LHS</i>		<i>RHS</i>									
11																			
12																			
13																			
14																			
15																			
16																			
17																			
18																			
19																			
20																			
21																			
22																			
23																			
24																			

ソルバーのパラメーター

目的セルの設定:(I)

目標値: ☐ 最大値(M) ☒ 最小値(N) ☐ 指定値:(V)

変数セルの変更:(B)

制約条件の対象:(U)

☒ 制約のない変数を非負数にする(K)

解決方法の選択:

解決方法
滑らかな非線形を示すソルバー問題には GRG 非線形エンジン、線形を示すソルバー問題には LP シンプレックス エンジン、滑らかではない非線形を示すソルバー問題にはエボリューションエンジンを選択してください。

線形計画問題とは？

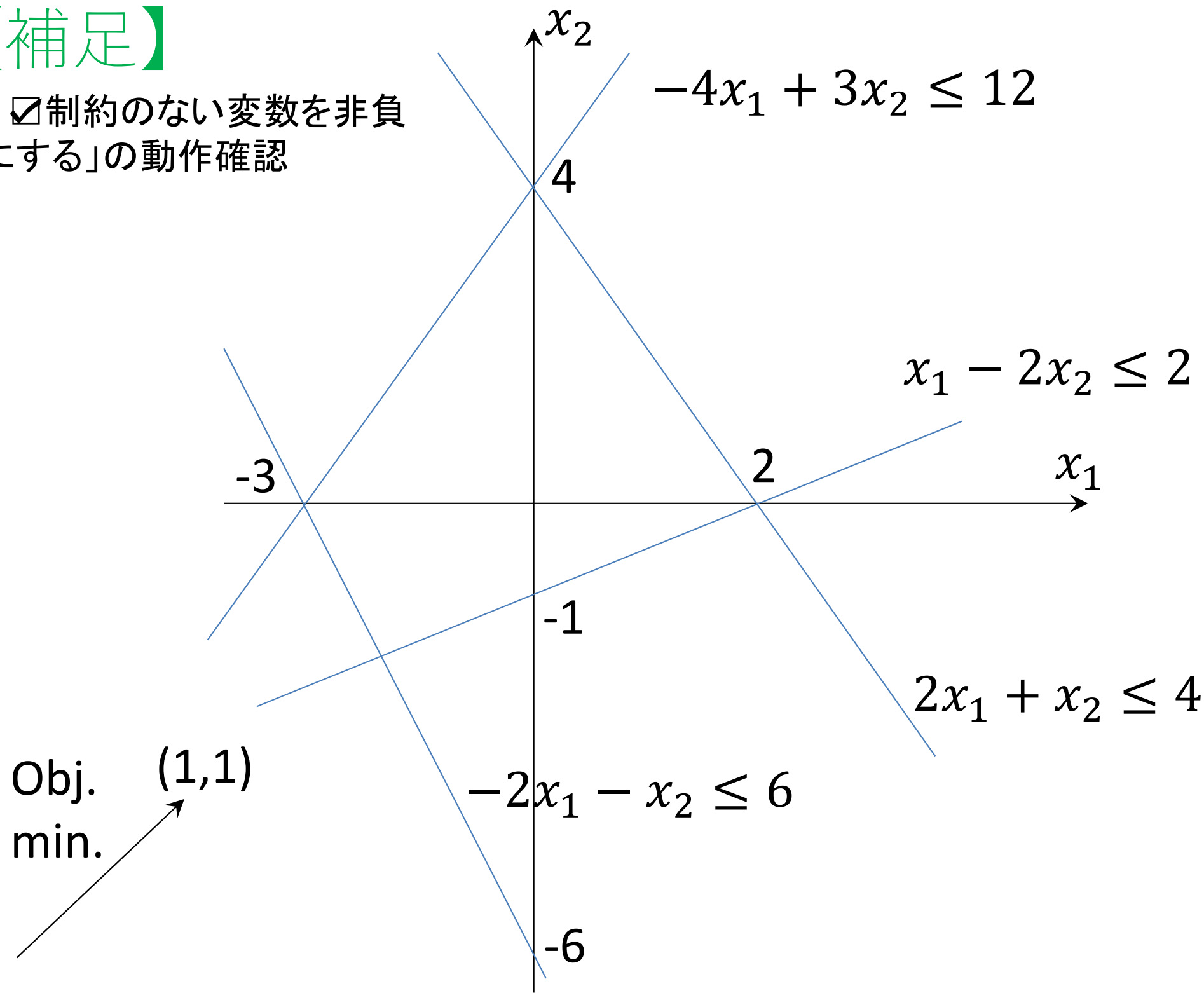
【演習】

- 以下のLPについてExcel solverで最適解を求めよ

$$\begin{array}{ll}\min. & x_1 + x_2 \\ \text{s.t.} & -4x_1 + 3x_2 \leq 12 \\ & x_1 - 2x_2 \leq 2 \\ & 2x_1 + x_2 \leq 4 \\ & -2x_1 - x_2 \leq 6 \\ & x_1, x_2 \geq 0\end{array}$$

【補足】

「☒ 制約のない変数を非負にする」の動作確認



【補足】

「☒制約のない変数を非負にする」の動作確認

✓ 4つのケースで最適解がどう変わるか(どの制約が活きるか)確認

- ① ☒制約のない変数を非負にする
- ② ☐制約のない変数を非負にする
- ③ ☒制約のない変数を非負にする & 制約「 $x_1 \geq -1$ 」を追加
- ④ ☒制約のない変数を非負にする & 制約「 $x_2 \geq -1$ 」を追加

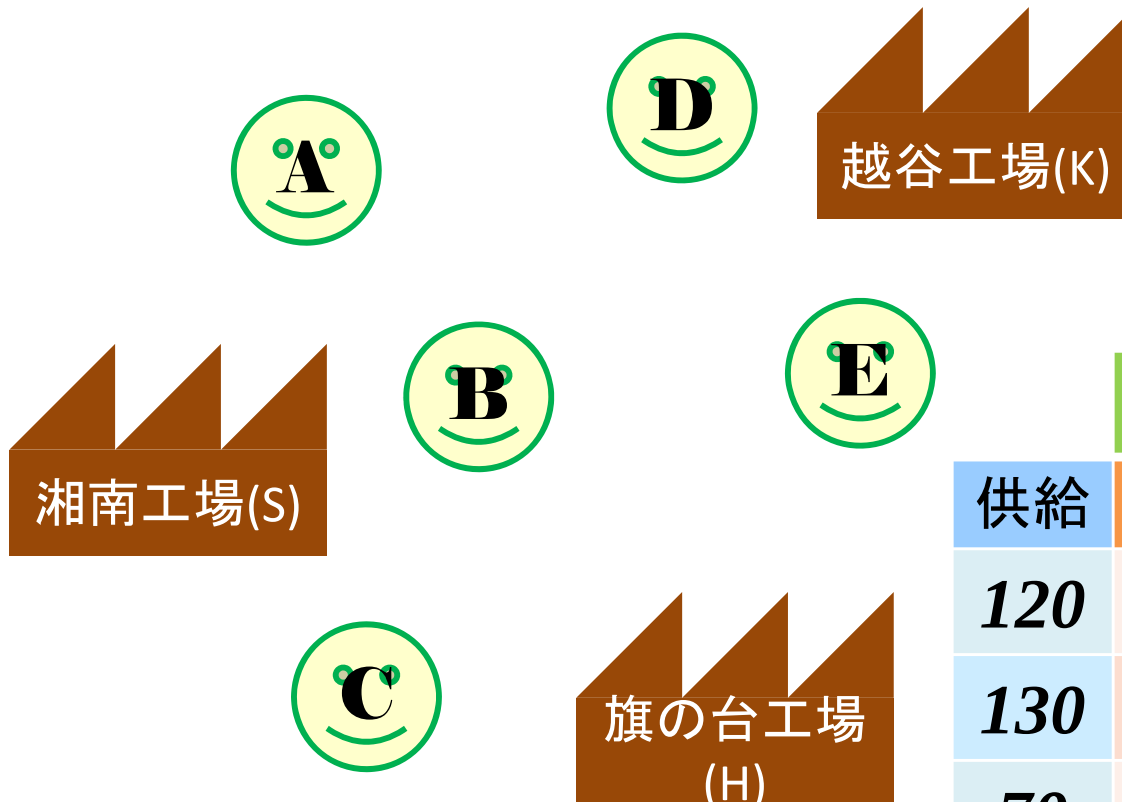
	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q
1	「制約のない変数を非負にする」へのチェックについて動作確認												opt. sol.			つまり追加される制約は	
2			x_1	x_2									x_1	x_2		x_1	x_2
3			0	-1							☒ 制約のない変数を非負にする	→	0	0		$x_1 \geq 0$	$x_2 \geq 0$
4																	
5	min		1	1	=	-1					☐ 制約のない変数を非負にする	→	-2	-2		なし	なし
6	s.t.		1	-2	=	2	$\leq$	2									
7			-4	3	=	-3	$\leq$	12			☒ 制約のない変数を非負にする	→	-1	0		なし	$x_2 \geq 0$
8			2	1	=	-1	$\leq$	4			& [$x_1 \geq -1$]						
9			-2	-1	=	1	$\leq$	6									
10											☒ 制約のない変数を非負にする	→	0	-1		$x_1 \geq 0$	なし
11											& [$x_2 \geq -1$]						

輸送問題

問) 文教重工には3工場(湘南・越谷・旗の台)あり, 製品を供給(製品生産量)できる

顧客は5人いて, 需要(製品を欲しい量)がある

3工場から5人の顧客それぞれへの単位あたり輸送コストは表の通り
輸送コストが最小となる配送計画をたてよ



- ✓ 工場の供給量
- ✓ 顧客の需要量
- ✓ 工場から顧客へ製品を1単位配送するのにかかる輸送コスト表

		需要	50	80	60	70	40
供給	工場\顧客	A	B	C	D	E	
120	湘南(S)	3	2	4	5	8	
130	越谷(K)	5	6	5	3	2	
70	旗の台(H)	7	3	1	2	3	

線形計画法

- 線形計画法 Linear Programming, LP
- 問題のモデル化

- 目的: 輸送コストを最小
- 条件1: 顧客の需要を満たす
- 条件2: 工場の出荷量は供給量まで
- 条件3: 輸送量は非負

目的関数 objective function

制約条件 constraints

非負条件 nonnegativity

- 変数設定

x_{ij} : 工場 i → 顧客 j への輸送量

ex) $x_{SB} = 30$: 湘南工場(S)から
顧客Bへ製品を30輸送する
その輸送コスト: $2 \times 30 = 60$

	需要	50	80	60	70	40
供給	工場\顧客	A	B	C	D	E
120	湘南(S)	3	2	4	5	8
130	越谷(K)	5	6	5	3	2
70	旗の台(H)	7	3	1	2	3

線形計画法

• 問題のモデル化

- 目的: 輸送コストを最小
- 条件1: 顧客の需要を満たす
- 条件2: 工場の出荷量は供給量まで
- 条件3: 輸送量は非負

• 問題の定式化 (LPファイル形式)

minimize

$$\begin{aligned}
 & 3 x_{SA} + 2 x_{SB} + 4 x_{SC} + 5 x_{SD} + 8 x_{SE} \\
 & + 5 x_{KA} + 6 x_{KB} + 5 x_{KC} + 3 x_{KD} + 2 x_{KE} \\
 & + 7 x_{HA} + 3 x_{HB} + 1 x_{HC} + 2 x_{HD} + 3 x_{HE}
 \end{aligned}$$

subject to

$$x_{SA} + x_{KA} + x_{HA} = 50$$

...

$$x_{SA} + x_{SB} + x_{SC} + x_{SD} + x_{SE} \leq 120$$

...

需要		50	80	60	70	40
供給	工場\顧客	A	B	C	D	E
120	湘南(S)	3	2	4	5	8
130	越谷(K)	5	6	5	3	2
70	旗の台(H)	7	3	1	2	3

目的関数 objective function

制約条件 constraints

非負条件 nonnegativity

線形計画法

• 問題の定式化

需要		50	80	60	70	40
供給	工場\顧客	A	B	C	D	E
120	湘南(S)	3	2	4	5	8
130	越谷(K)	5	6	5	3	2
70	旗の台(H)	7	3	1	2	3

minimize

$$\begin{aligned} & 3x_{SA} + 2x_{SB} + 4x_{SC} + 5x_{SD} + 8x_{SE} \\ & + 5x_{KA} + 6x_{KB} + 5x_{KC} + 3x_{KD} + 2x_{KE} \\ & + 7x_{HA} + 3x_{HB} + 1x_{HC} + 2x_{HD} + 3x_{HE} \end{aligned}$$

subject to

$$\begin{aligned} x_{SA} + x_{KA} + x_{HA} &= 50 \\ x_{SB} + x_{KB} + x_{HB} &= 80 \\ x_{SC} + x_{KC} + x_{HC} &= 60 \\ x_{SD} + x_{KD} + x_{HD} &= 70 \\ x_{SE} + x_{KE} + x_{HE} &= 40 \\ x_{SA} + x_{SB} + x_{SC} + x_{SD} + x_{SE} &\leq 120 \\ x_{KA} + x_{KB} + x_{KC} + x_{KD} + x_{KE} &\leq 130 \\ x_{HA} + x_{HB} + x_{HC} + x_{HD} + x_{HE} &\leq 70 \end{aligned}$$

end

目的関数 objective function

制約条件 constraints

非負条件 nonnegativity

※LPファイル形式では書かない

→ ファイル名「ex.lp」で保存(LPファイル)

線形計画法

- 問題を解く

- ソルバー

- gurobi (Zonghao **Gu**, Edward **R**othberg, Robert **B**ixby)
 - cplex (IBM ILOG CPLEX)
 - Xpress (FICO, MSI)
 - SCIP (ZIB, **S**olving **C**onstraint **I**nteger **P**rograms)
 - lp solve
 - GLPK (**G**nu **L**inear **P**rogramming **K**it)
 - Excel solver (Microsoft)
 - etc.

- LPファイル(例: **ex.lp**)を読み込んで最適化！

- 文教大の環境では, **Y:¥LP** に保存(**Yドライブ**の**LPフォルダ**)

線形計画法

- gurobiで最適化(解く)

Y:>**cd LP** [Enter]

Y:¥LP>**gurobi** [Enter]

LPファイル読込

gurobi> **m=read("ex.lp")**

最適化(解く)

gurobi> **m.optimize()**

解の表示

gurobi> **m.printAttr('X')**

gurobi> **m.ObjVal**

※win8: 左下winマークで**右**クリック→「コマンドプロンプト」
※win7: 左下winマーク→「すべてのプログラム」→「アクセサリ」→

- 「**コマンドプロンプト**」を起動する
- '**ex.lp**'ファイルが保存されているフォルダへ移動(例では Yドライブの LPフォルダ)
(**cd** = **change directory**)
- '**gurobi**'コマンドでgurobi を起動する

```
cmd コマンドプロンプト - gurobi
gurobi> m = read("ex.lp")
gurobi> m.optimize()
Optimize a model with 8 rows, 15 columns and 30 nonzeros
Presolve time: 0.00s
Presolved: 8 rows, 15 columns, 30 nonzeros

Iteration    Objective          Primal Inf.    Dual Inf.        Time
     0      5.9000000e+02   7.000000e+01   0.000000e+00      0s
     2      6.7000000e+02   0.000000e+00   0.000000e+00      0s

Solved in 2 iterations and 0.01 seconds
Optimal objective  6.7000000000e+02
gurobi> m.printAttr('X')

Variable      X
-----
xSA           50
xSB           70
xKD           70
xKE           40
xHB           10
xHC           60
gurobi> m.ObjVal
670.0
gurobi>
```

線形計画法

- cplexで最適化(解く)

Y:>cd LP [Enter]

Y:¥LP>cplex [Enter]

LPファイル読込

CPLEX> read ex.lp

問題の表示

CPLEX> d p a

最適化(解く)

CPLEX> opt

解の表示

CPLEX> d so v -

```
コマンドプロンプト - cplex
CPLEX> read ex.lp
Problem "ex.lp" read.
Read time = 0.00 sec. (0.00 ticks)
CPLEX> d p a
Minimize
obj: 3 xSA + 2 xSB + 4 xSC + 5 xSD + 8 xSE + 5 xKA + 6 xKB + 5 xKC + 3 xKD
      + 2 xKE + 7 xHA + 3 xHB + xHC + 2 xHD + 3 xHE
Subject To
c1: xSA + xKA + xHA = 50
c2: xSB + xKB + xHB = 80
c3: xSC + xKC + xHC = 60
c4: xSD + xKD + xHD = 70
c5: xSE + xKE + xHE = 40
c6: xSA + xSB + xSC + xSD + xSE <= 120
c7: xKA + xKB + xKC + xKD + xKE <= 130
c8: xHA + xHB + xHC + xHD + xHE <= 70
Bounds
All variables are >= 0.
CPLEX> opt
Tried aggregator 1 time.
No LP presolve or aggregator reductions.
Presolve time = -0.00 sec. (0.01 ticks)

Iteration log . . .
Iteration:    1    Dual objective      =      160.000000

Dual simplex - Optimal: Objective = 6.7000000000e+002
Solution time =    0.00 sec. Iterations = 7 (0)
Deterministic time = 0.01 ticks (13.28 ticks/sec)

CPLEX> d so v -
Variable Name      Solution Value
xSA                40.000000
xSB                80.000000
xKA                10.000000
xKD                60.000000
xKE                40.000000
xHC                60.000000
xHD                10.000000
All other variables in the range 1-15 are 0.
CPLEX>
```

d p a = display problem all

opt = optimize

d so v = display solution variables

輸送問題

最適値

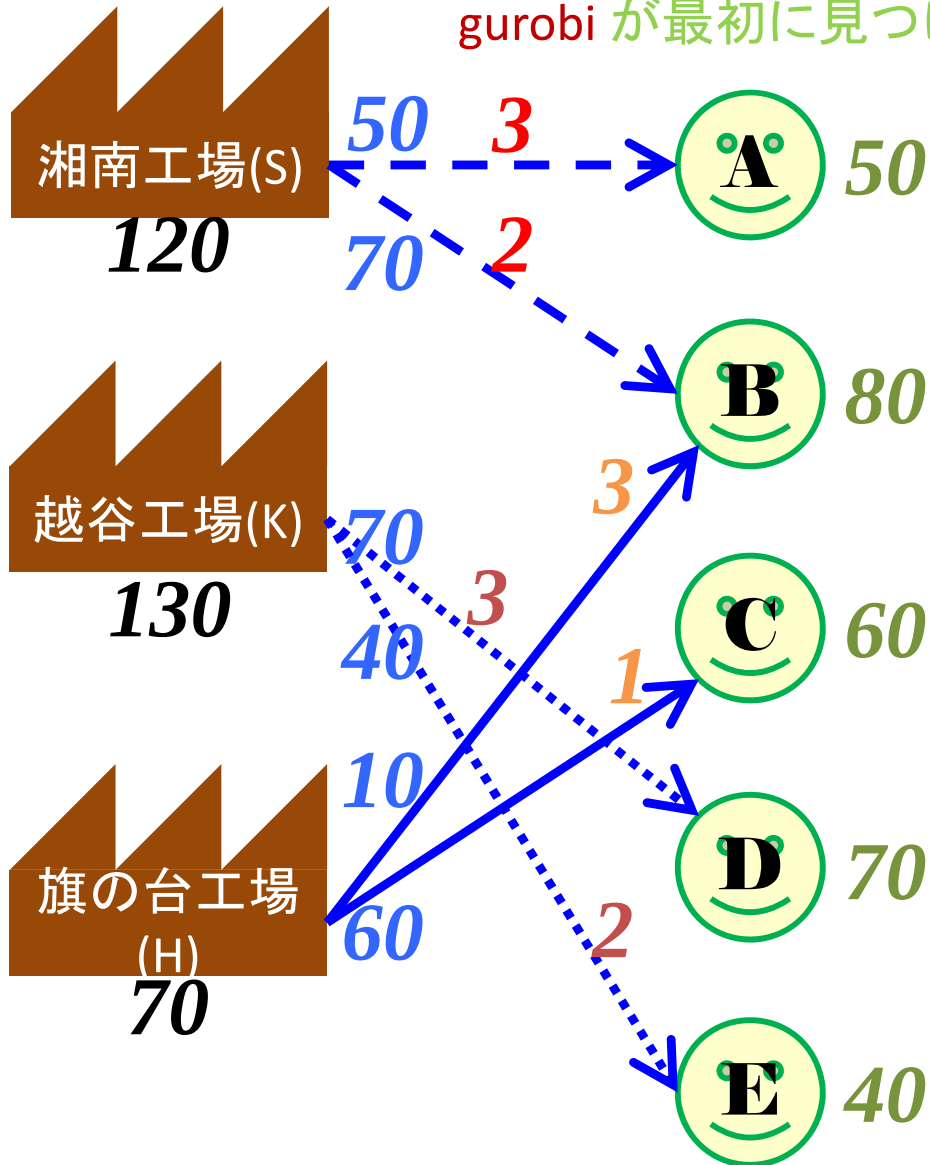
$$670 = 6.7 \times 10^2$$

```
Optimal objective 6.700000000e+02
gurobi> m.printAttr('X')

Variable      X
-----
xSA           50
xSB           70
xKD           70
xKE           40
xHB           10
xHC           60
gurobi> m.ObjVal
670.0
```

最適解・最適値の評価・検証)

gurobi が最初に見つけた解



- ✓ 工場の供給量
- ✓ 顧客の需要量
- ✓ 工場から顧客へ製品を1単位配送するのにかかる輸送コスト表

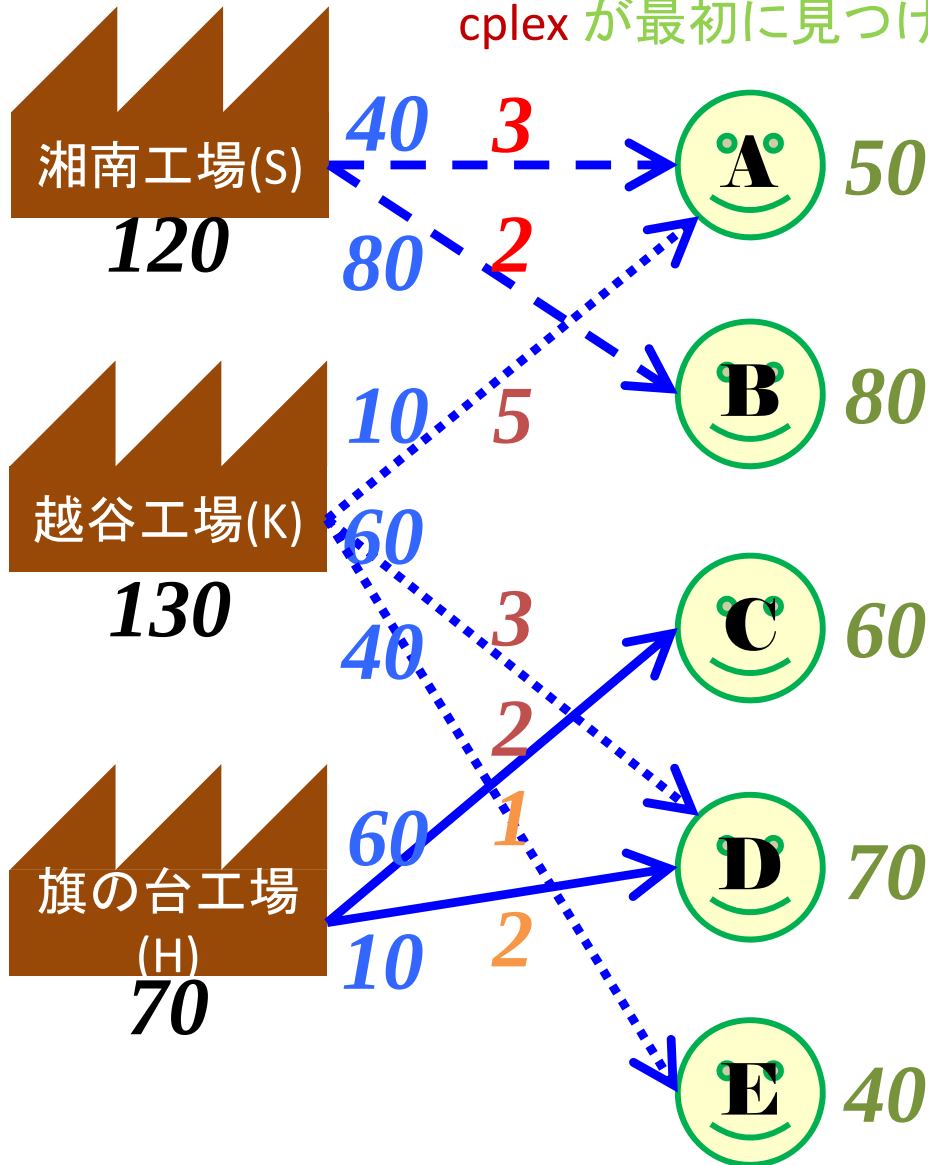
	需要	50	80	60	70	40
供給	工場\顧客	A	B	C	D	E
120	湘南(S)	3	2	4	5	8
130	越谷(K)	5	6	5	3	2
70	旗の台(H)	7	3	1	2	3

輸送問題

最適値
 $670 = 6.7 \times 10^2$

最適解・最適値の評価・検証)

cplex が最初に見つけた解



```
Dual simplex - Optimal: Objective = 6.7000000000e+002
Solution time = 0.00 sec. Iterations = 7 (0)
Deterministic time = 0.01 ticks (13.28 ticks/sec)

CPLEX> d so v -
Variable Name      Solution Value
xSA                40.000000
xSB                80.000000
xKA                10.000000
xKD                60.000000
xKE                40.000000
xHC                60.000000
xHD                10.000000
All other variables in the range 1-15 are 0.
```

- ✓ 工場の供給量
- ✓ 顧客の需要量
- ✓ 工場から顧客へ製品を1単位配送するのにかかる輸送コスト表

	需要	50	80	60	70	40
供給	工場\顧客	A	B	C	D	E
120	湘南(S)	3	2	4	5	8
130	越谷(K)	5	6	5	3	2
70	旗の台(H)	7	3	1	2	3

栄養問題 diet problem

• 例題

『なめがやわーんど』では、「神秘ケーキ」「魅惑菓子」「苦渋野菜」「過酸果物」の4つの食べ物と、「だんはっく」「ガルジウム」「ヒタビン」という3つの栄養素, 3つの食品含有物「糖分」「塩分」「カロリー」が存在する. 4つの食べ物は3つの栄養素と3つの食品含有物を, 1単位当たり各々下表に示す量だけ含む

栄養素	神秘ケーキ	魅惑菓子	苦渋野菜	過酸果物
だんはっく	3	1	4	2
ガルジウム	1	2	2	1
ヒタビン	2	1	2	5
糖分	7	5	3	4
塩分	1	2	4	8
カロリー	40	50	55	20

『なめがやわーんど』人は, 3栄養素を一日に各々最低50, 40, 60は摂取しないと死んでしまう! また, 糖分と塩分は各々一日に150を超えると過剰摂取で死んでしまう!! ダイエットしたい花子さんのために, カロリーを最小にする食べ物の量を教えて欲しい

【演習】 LPに定式化して Solver で求解せよ

栄養問題の定式化と求解

- 例題: 定式化例

$$\begin{array}{ll}\text{min.} & 40x_1 + 50x_2 + 55x_3 + 20x_4 \\ \text{s.t.} & 3x_1 + x_2 + 4x_3 + 2x_4 \geq 50 \\ & x_1 + 2x_2 + 2x_3 + x_4 \geq 40 \\ & 2x_1 + x_2 + 2x_3 + 5x_4 \geq 60 \\ & 7x_1 + 5x_2 + 3x_3 + 4x_4 \leq 150 \\ & x_1 + 2x_2 + 4x_3 + 8x_4 \leq 150 \\ & x_1, x_2, x_3, x_4 \geq 0\end{array}$$

割当問題 assignment problem

• 例題

上司が10人の部下に仕事をまかせようとしている

仕事は全部で15種類ある(A,B,C,...,O)

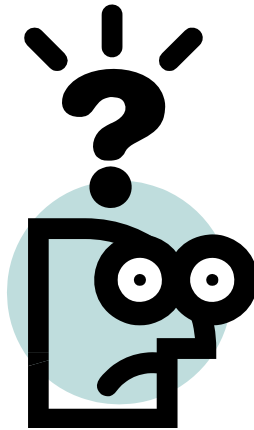
10人の部下の内, 4人は新人で6人はベテランである

各々の仕事をどの部下がやるかにより, 上司は事前に5段階評価している(1,...,5)

ベテランは同時に2つまで仕事をまかせられる

新人は同時に1つまでしか仕事をまかせられず, どの仕事の最大評価も3(1,...,3)

評価値総和が最大になるように, 各部下に仕事を割り振りたい



【演習】 LPに定式化して Solver で求解せよ

割当問題の定式化と求解

- 例題: 定式化例

$$\begin{aligned} \min. \quad & 3x_{1A} + x_{1B} + x_{1C} + \cdots + 3x_{1N} + 3x_{1O} \\ & + \cdots + \\ & + 4x_{10A} + 5x_{10B} + 5x_{10C} + \cdots + 3x_{10N} + 5x_{10O} \\ \text{s.t.} \quad & \left\{ \begin{array}{l} x_{1A} + x_{1B} + x_{1C} + \cdots + x_{1O} \leq 1 \\ \cdots \\ x_{10A} + x_{10B} + x_{10C} + \cdots + x_{10O} \leq 2 \end{array} \right. \\ & \left\{ \begin{array}{l} x_{1A} + x_{2A} + \cdots + x_{10A} = 1 \\ \cdots \\ x_{1O} + x_{2O} + \cdots + x_{10O} = 1 \\ x_{1A}, \dots, x_{10O} \in \{0,1\} \end{array} \right. \end{aligned}$$

制約式①は、部下達は1ないし2の仕事を担当できる

制約式②は、各仕事は必ず誰かが担当する

0-1制約は $0 \leq x_{ij} \leq 1$ にして解いてよい(補足: 完全単模行列)

【補足】

- 単模行列(unimodular matrix)

- def) 整数正方行列 $A \in R^{n \times n}$ が単模行列 $\Leftrightarrow \det A = 1 \text{ or } -1$

- th) 単模行列の逆行列も, 整数行列で単模行列

- 完全単模行列(totally unimodular matrix)

- def) 整数行列 $A \in R^{m \times n}$ が完全単模行列

- $\Leftrightarrow$ 任意の小行列式の値が 0 or 1 or -1

- th) 完全単模行列の各要素は 0 or 1 or -1

- ex) 有向グラフの接続行列は完全単模

- ex) 無向グラフの接続行列が完全単模となる必要十分条件はグラフが2部であること(cf. 3点奇数サイクルのグラフは $\det A = \pm 2$)

- th) LP(P)が最適解をもち, 係数行列 A が完全単模とする. b が整数ベクトルなら, (P)は整数最適解 $x \in Z^n$ をもつ

$$\begin{array}{ll} (P) \max. & c^t x \\ \text{s.t.} & Ax = b \\ & x \geq 0 \end{array}$$

(proof) (P)の基底 B に対する基底解は $(B^{-1}b, 0)$
 A が完全単模なので, B は単模行列
よって, B^{-1} は整数行列. 故に $B^{-1}b$ は整数ベクトル ■

クラス編成問題 student sectioning

• 例題

33人の学生を6つのクラスに配属させたい

各学生は丁度1つのクラスに所属させ、配属しないという選択はないとする

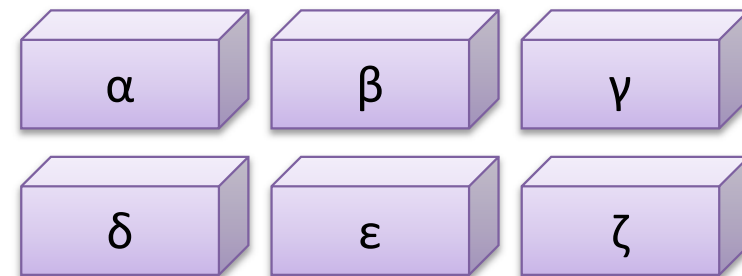
各学生は6つのクラスへの希望を持っている(第1志望～第3志望)のみ

クラスには定員があり、全て6人である(容量6人×6クラス=36人で充分)

全学生の満足度総和が最大になるように学生をクラスへ配属させなさい



6クラス(各定員6人)



【演習】 LPに定式化して Solver で求解せよ

クラス編成問題の定式化と求解

- 例題: 定式化例

$$\begin{aligned} \min. \quad & -999x_{1\alpha} + 30x_{1\beta} + 100x_{1\gamma} - 999x_{1\delta} - 999x_{1\varepsilon} + 60x_{1\zeta} \\ & + \dots + \end{aligned}$$

$$+ 30x_{1\alpha} + 100x_{1\beta} + 60x_{1\gamma} - 999x_{1\delta} - 999x_{1\varepsilon} - 999x_{1\zeta}$$

$$\begin{aligned} \text{s.t.} \quad & \left\{ \begin{array}{l} x_{1\alpha} + x_{1\beta} + x_{1\gamma} + \dots + x_{1\zeta} = 1 \\ \dots \\ x_{33\alpha} + x_{33\beta} + x_{33\gamma} + \dots + x_{33\zeta} = 1 \end{array} \right. \\ & \left\{ \begin{array}{l} x_{1\alpha} + x_{2\alpha} + \dots + x_{33\alpha} \leq 6 \\ \dots \\ x_{1\zeta} + x_{2\zeta} + \dots + x_{33\zeta} \leq 6 \\ x_{1\alpha}, \dots, x_{33\zeta} \in \{0,1\} \end{array} \right. \end{aligned}$$

制約式①は、各学生は6クラスのどこか1か所に所属する

制約式②は、各クラスの定員は6人

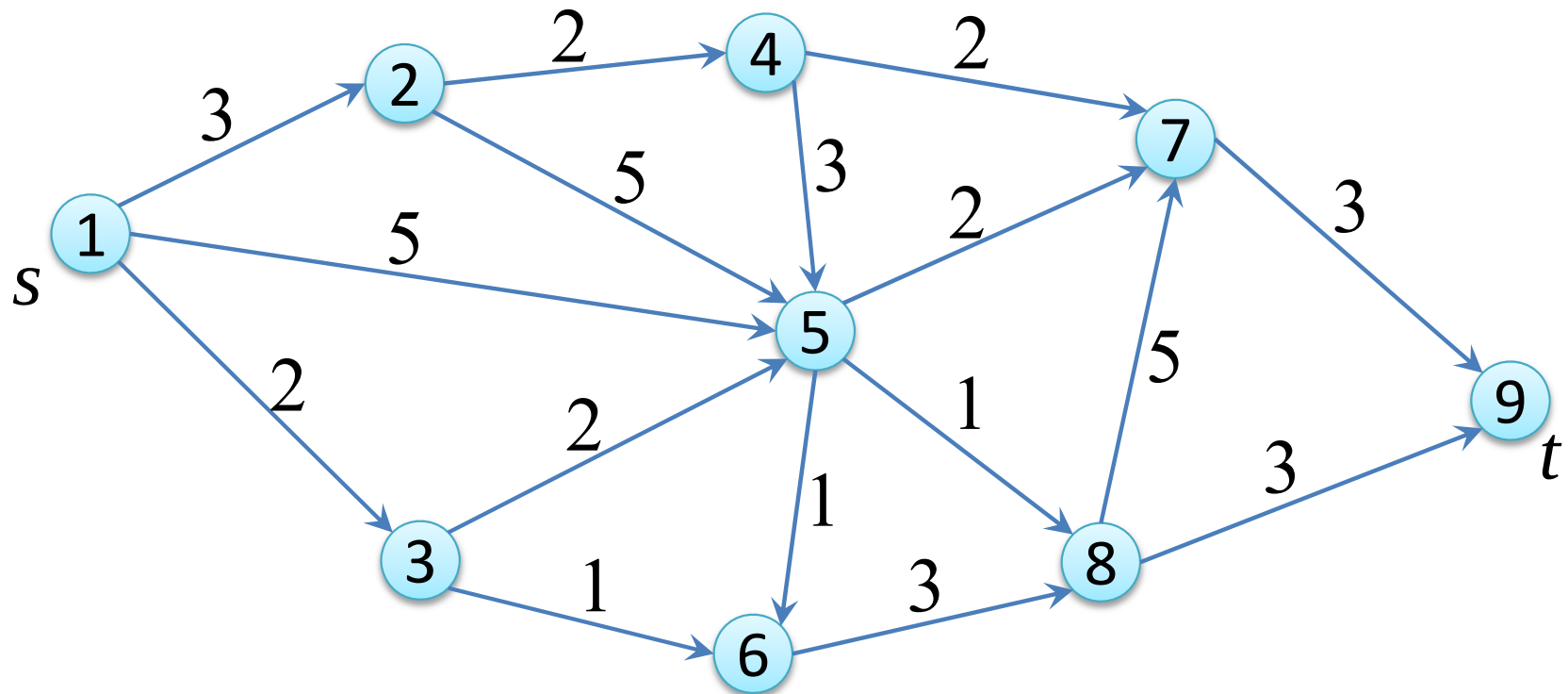
0-1制約は $0 \leq x_{ij} \leq 1$ にして解いてよい(補足: 完全単模行列)

最短路問題 shortest path problem

• 例題

グラフ $G=(V,E)$ と枝上のコスト(cost)が与えられている

スタート地点(点1)からゴール地点(点9)まで、コストの総和が最小となる路をもとめよ



【演習】

LPに定式化して Excel Solver で求解せよ

(LPファイルで定式化を書くより, Excel の方が定式化が楽)

最短路問題の定式化と求解

- 例題：定式化例

0-1変数 x_{ij} は、枝 $(i,j) \in E$ について、
経路として使うなら1、使わないなら0

$$\begin{aligned} \min. \quad & \sum_{(i,j) \in E} c_{ij} x_{ij} \\ \text{s.t.} \quad & \sum_{j \in V} x_{ij} - \sum_{j \in V} x_{ji} = \begin{cases} 1 & (i=s) \\ 0 & (\forall i \in V \setminus \{s,t\}) \\ -1 & (i=t) \end{cases} \\ & x_{ij} \in \{0,1\} \quad (\forall (i,j) \in E) \end{aligned}$$

点iからの流出量の和 点iへの流入量の和

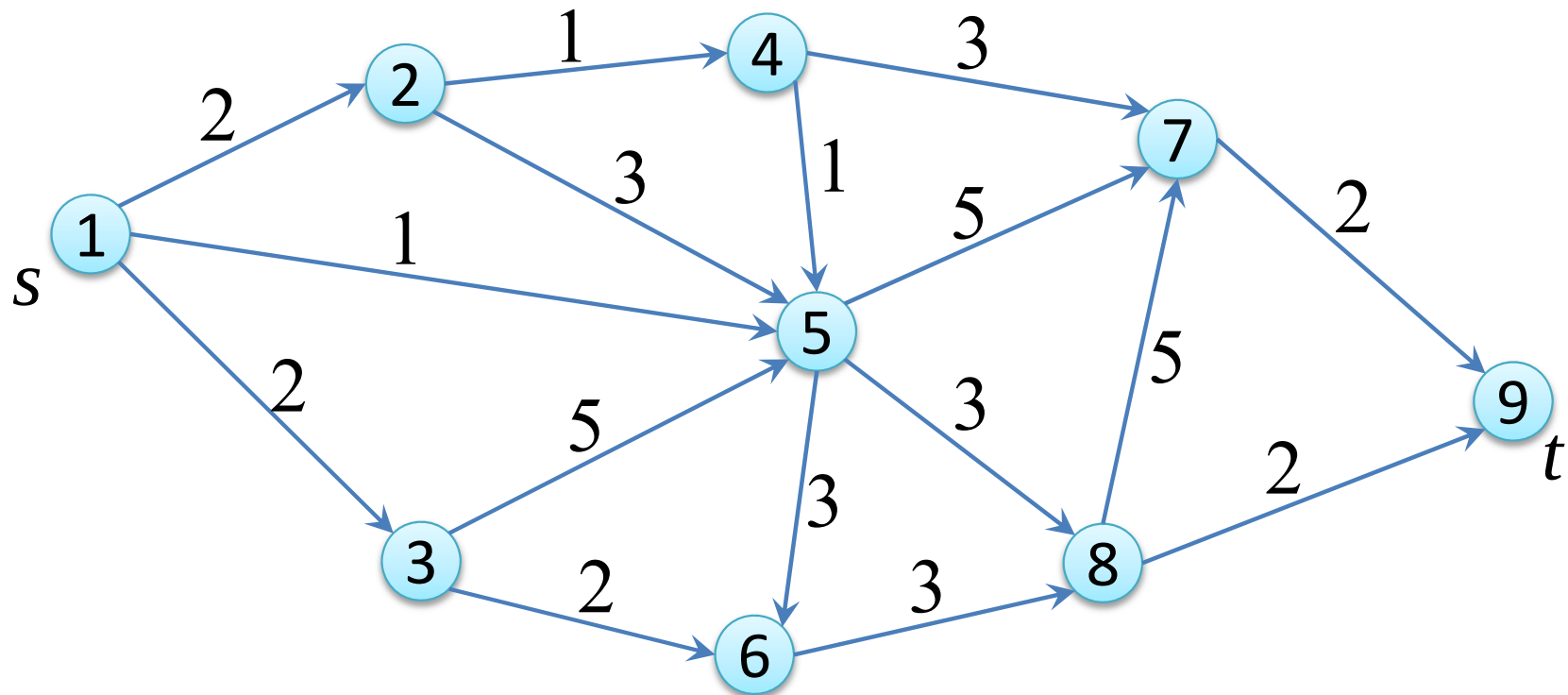
制約式は、「点iからの流出量の和」と「点iへの流入量の和」との差に関するもので
点iがスタート地点 ($i=s$) なら1, ゴール地点 ($i=t$) なら-1, それ以外なら0とする
(スタートは流出のみ, 途中は流入分すべて流出し, ゴールは流入のみということ)

0-1制約「 $x_{ij} \in \{0,1\}$ 」は線形緩和「 $0 \leq x_{ij} \leq 1$ 」して解いてよい

最大流問題 maximum flow problem

• 例題

グラフ $G=(V,E)$ と枝 $(i,j) \in E$ 上の容量 (capacity) u_{ij} が与えられている
スタート地点 (点1) からゴール地点 (点9) まで、最大流量を流せ



【演習】

LPに定式化して Excel Solver で求解せよ
(LPファイルで定式化を書くより, Excel の方が定式化が楽)

最大流問題の定式化と求解

- 例題: 定式化例

実数変数 x_{ij} は, 枝 $(i,j) \in E$ に流れる流量

$$\begin{aligned} \max. \quad & \sum_{j \in V} x_{sj} \\ \text{s.t.} \quad & \sum_{j \in V} x_{ij} - \sum_{j \in V} x_{ji} = 0 \quad (\forall i \in V \setminus \{s, t\}) \\ & 0 \leq x_{ij} \leq u_{ij} \quad (\forall (i, j) \in E) \end{aligned}$$

点iからの流出量の和

点iへの流入量の和

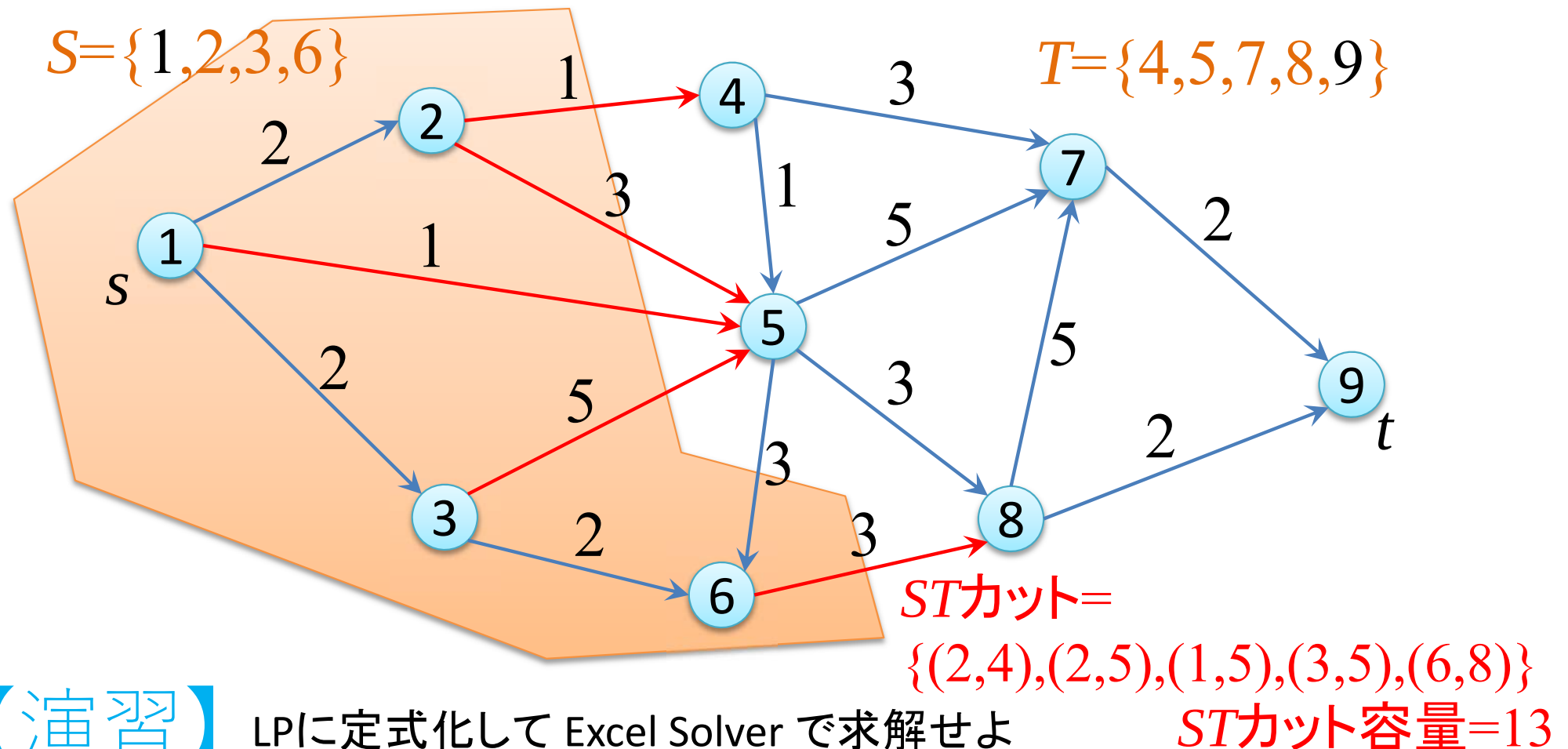
制約式は, 流量保存則. すなわち,

「点iからの流出量の和」と「点iへの流入量の和」との差が0(流量保存)とする
(スタートは流出のみ, ゴールは流入のみなので制約から除外されることに注意)
(目的関数は, スタート点sからの流出量の和を最大化していることに注意)

最小カット問題 minimum cut problem

• 例題

グラフ $G=(V,E)$ と枝 $(i,j) \in E$ 上の容量 (capacity) u_{ij} が与えられている
スタート点 (点1) を含む点集合を S , ゴール点 (点9) を含む点集合を T とし, V を S と T に分割
このとき, S から T への枝の集合を ST カットとよぶ. 容量が最小となる ST カットを求めよ



【演習】

LPに定式化して Excel Solver で求解せよ
(LPファイルで定式化を書くより, Excel の方が定式化が楽)

最小カット問題の定式化と求解

- 例題: 定式化例

$$\min. \sum_{(i,j) \in E} u_{ij} z_{ij}$$

$$\text{s.t. } y_i - y_j - z_{ij} \leq 0 \quad (\forall (i,j) \in E) \quad \dots \textcircled{1}$$

$$y_s = 1, y_t = 0 \quad \dots \textcircled{2}$$

$$z_{ij} \in \{0,1\} \quad (\forall (i,j) \in E)$$

$$y_i \in \{0,1\} \quad (\forall i \in V)$$

0-1整数変数 z_{ij} は,

枝 $(i,j) \in E$ がSTカットなら1, 違うなら0

0-1整数変数 y_i は,

点 $i \in V$ が集合Sに含まれるなら1, 違うなら0

カット制約①は, $i \in S, j \in T$ のとき $y_i=1, y_j=0$ で, $z_{ij}=1$ となることを要求する制約
それ以外, $i, j \in S$ ($y_i=y_j=1$) や $i, j \in T$ ($y_i=y_j=0$) では, $z_{ij}=1$ でも0でもよい. つまり, 制約として意味がない. しかし目的関数が最小化なので, これらのときは $z_{ij}=0$ となる
(z_{ij}, y_i の0-1制約は, LP緩和して $0 \leq z_{ij} \leq 1, 0 \leq y_i \leq 1$ で解いてよい)

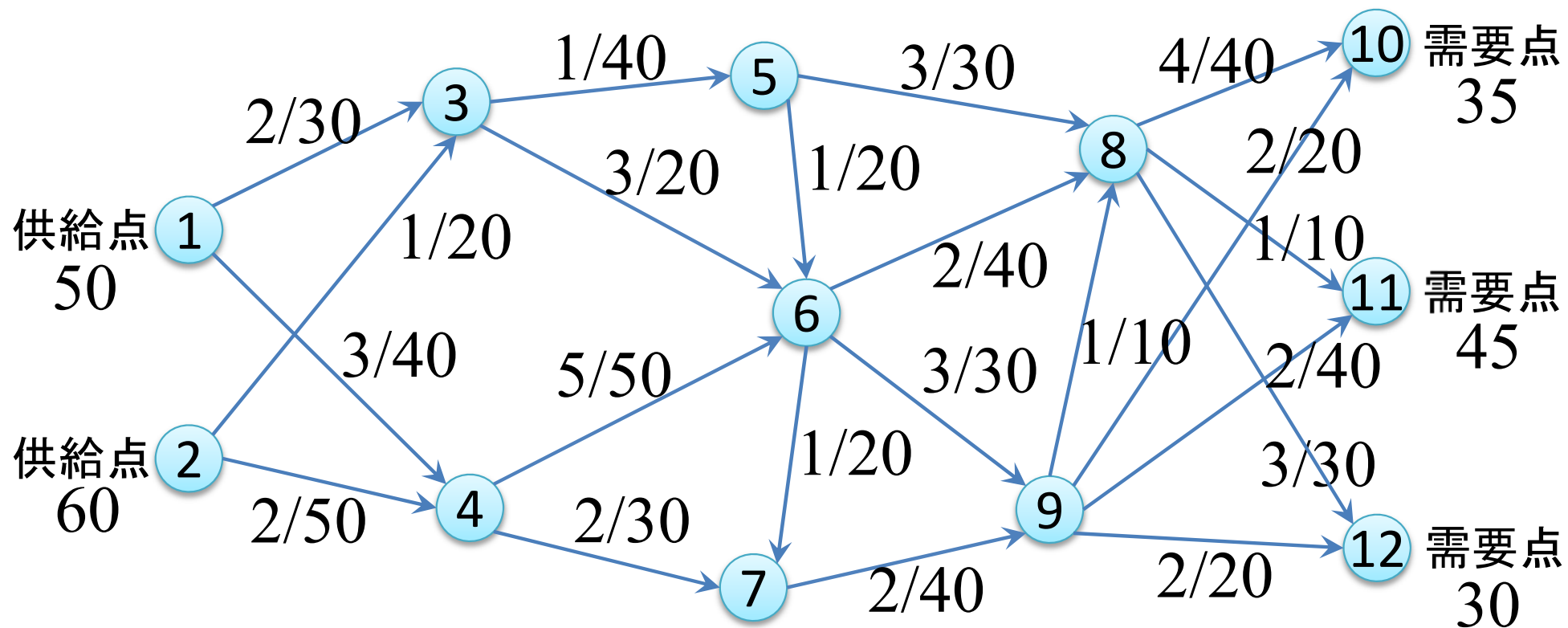
【補足】

- 最大フロー・最小カット定理 (max-flow min-cut theorem)
 - th) 最大フローが存在するとき,
最大流量 = 最小カット容量
- 最大流問題を主問題(P)としたとき, 双対問題(D)が最小カット問題となる
 - 最大フロー・最小カット定理は, 双対定理の特殊ケース
- 双対定理 (Duality Theorem)
 - th) LPの主問題(P)と双対問題(D)がどちらも実行可能なら, いずれも最適解を持ち最適値が一致する

最小費用流問題 minimum cost flow problem

● 例題

グラフ $G=(V,E)$ と枝 $(i,j) \in E$ 上のコスト(cost) c_{ij} と容量(capacity) u_{ij} が与えられている
与えられた需要点の需要と供給点の供給量を満たすフローを考える
実行可能なフローのうちで費用最小となるものを求めよ



【演習】

LPに定式化して Excel Solver で求解せよ
(LPファイルで定式化を書くより, Excel の方が定式化が楽)

最小費用流問題の定式化と求解

• 例題：定式化例

実数変数 x_{ij} は、枝 $(i,j) \in E$ に流れる流量

$$\min. \quad \sum_{(i,j) \in E} c_{ij} x_{ij}$$

$$\text{s.t.} \quad \sum_{j \in V} x_{ij} - \sum_{j \in V} x_{ji} = b_i \quad (\forall i \in V) \quad \dots \textcircled{1}$$

$$0 \leq x_{ij} \leq u_{ij} \quad (\forall (i,j) \in E)$$

点 i からの流出量の和

点 i への流入量の和

流量保存制約①の右辺定数 b_i の値は以下の通り

- ✓ 供給点 $i \in V$ について $b_i = \text{その点の供給量}$
- ✓ 需要点 $i \in V$ について $b_i = -\text{その点の需要量}$
- ✓ それ以外の点 $i \in V$ について $b_i = 0$ (流量保存)

【補足】

- 最小費用流問題は、最短路問題と最大流問題を含む
 - 最小費用流問題の定式化において以下の設定をすれば良い
 - ✓ スタート点 $i=s$ について, $b_s=1$
 - ✓ ゴール点 $i=t$ について, $b_t=-1$
 - ✓ それ以外の点 i について, $b_i=0$
 - ✓ 全ての枝 (i,j) の容量 $u_{ij}=\infty$
 - 最小費用流問題の定式化において以下の設定をすれば良い
 - ✓ スタート点 $i=s$ について, $b_s=f$ ※ $f = \sum c_{sj}x_{sj}$
 - ✓ ゴール点 $i=t$ について, $b_t=-f$ ※ この流量制約冗長 (削除可)
 - ✓ それ以外の点 i について, $b_i=0$
 - ✓ スタート点からの枝 (s,j) のコスト $c_{sj}=1$
 - ✓ それ以外の枝 (i,j) のコスト $c_{ij}=0$

最短路問題

最大流問題

参考文献

1. 今野浩 「線形計画法」 日科技連 (1987)
2. 藤田・今野・田邊 「最適化法」 岩波書店 (1994)
3. 田村明久・村松正和 「最適化法」 共立出版 (2002)
4. 坂和正敏 「線形計画法の基礎と応用」 朝倉書店 (2012)
5. 小島・土谷・水野・矢部 「内点法」 朝倉書店 (2001)
6. *A. Schrijver: Theory of Linear and Integer Programming, John Wiley and Sons, 1986.*
7. *L.A. Wolsey: Integer Programming, John Wiley and Sons, 1998.*
8. *M. Conforti, G. Cornuejols and G. Zambelli: Integer Programming, Springer, 2014.*
9. 久保幹雄, J.P.ペドロソ, 村松正和, A.レイス：あたらしい数理最適化, 近代科学社, 2012.
10. 久保幹雄, 小林和博, 斉藤努, 並木誠, 橋本英樹：Python言語によるビジネスアナリティクス, 近代科学社, 2016.
11. 藤澤克樹, 後藤順哉, 安井雄一郎：Excelで学ぶOR, オーム社, 2011.