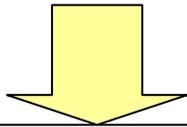


Mathematical Programming

最適化手法の王様
数理計画法

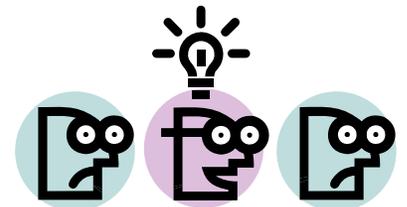
ここで学ぶこと

- 数理計画とは
- システム的アプローチによる問題解決



後半にて

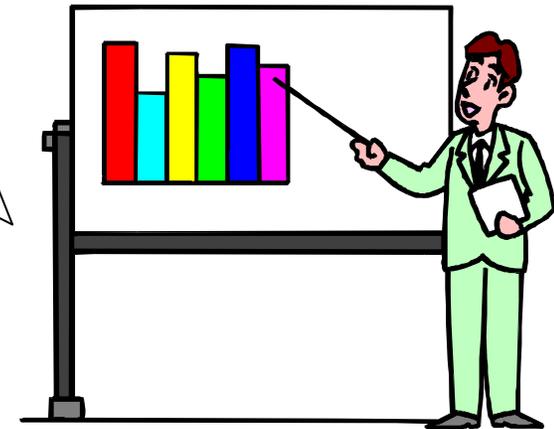
- 数理モデル化と表現方法(定式化)
- 数理計画問題の分類



数理計画とは Mathematical Programming

与えられた**制約式**のもとで、
ある**関数を最大化**する応用数学の問題
(最小化)

- 数理計画 = 数理計画問題
(一 problem)
- 数理計画問題とそれを解く手法
全般を「**数理計画法**」とよぶ。



数理計画とORの深い関係

数理計画(問題)

与えられた**制約式のもと**で、
ある**関数を最大(最小)**にする



ORの例: 経営の問題

与えられた**資源内**で
利益を最大(費用・リスクを最小)にする

ORとは?

対象を数学的にモデル化し、
有用な解決策を導く方法

ORは解決策を
導く手法の宝庫

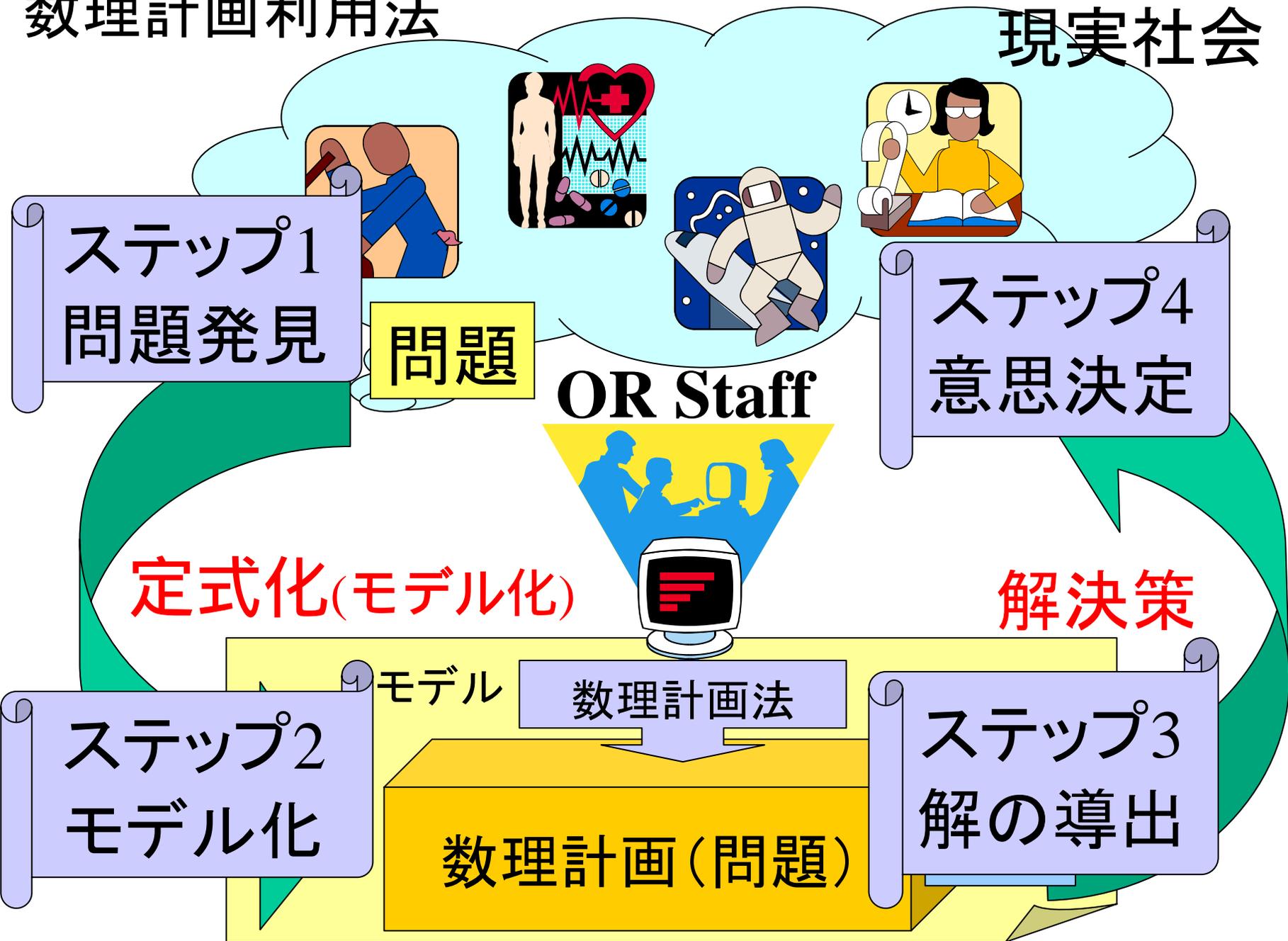
⇒数理計画は数理的な問題解決(OR)の中心的な技法として定着

ORの仕組み



数理計画利用法

現実社会



ステップ1 問題発見

何が問題？
因果関係は？

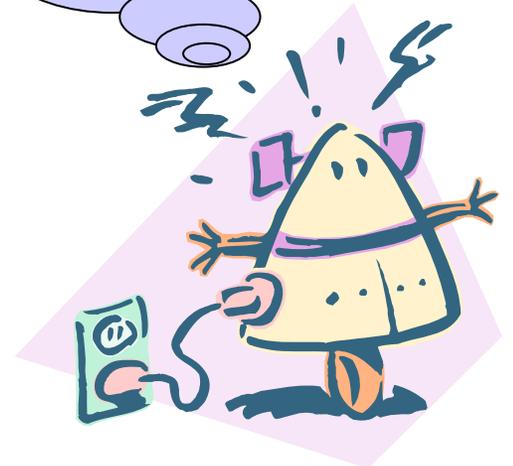
問題発見技法

- ブレインストーミング法
- KJ法
- QC(7つ道具, 新QC7つ道具) など

問題の舞台を**システム**で把握



問題は与えられることも多いが、発見することも重要！

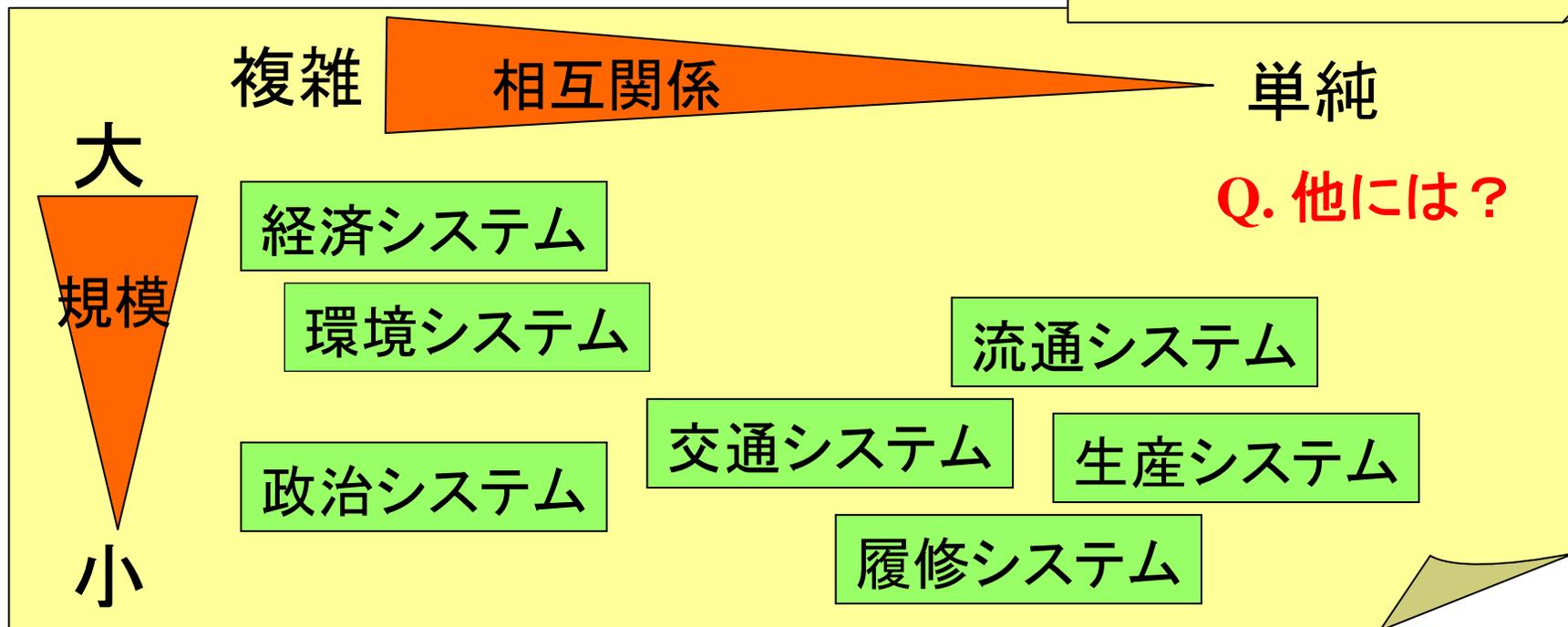


システムとして問題把握

相互関係を持つ構成要素の集まり
+
構成要素は共通目的で機能している

ポイント

- 構成要素の抽出
- 相互関係の明確化



※システムは小さなシステムの集まりの場合もある

問題を捉えるポイント

システムにおいて

- コントロールする(できる)構成要素は？
- コントロールに対する制約は？
- コントロール結果に対する
良い・悪いの尺度は？

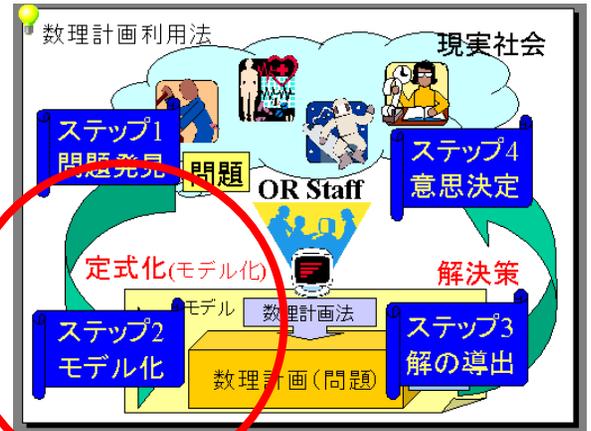


演習1 混雑する学食

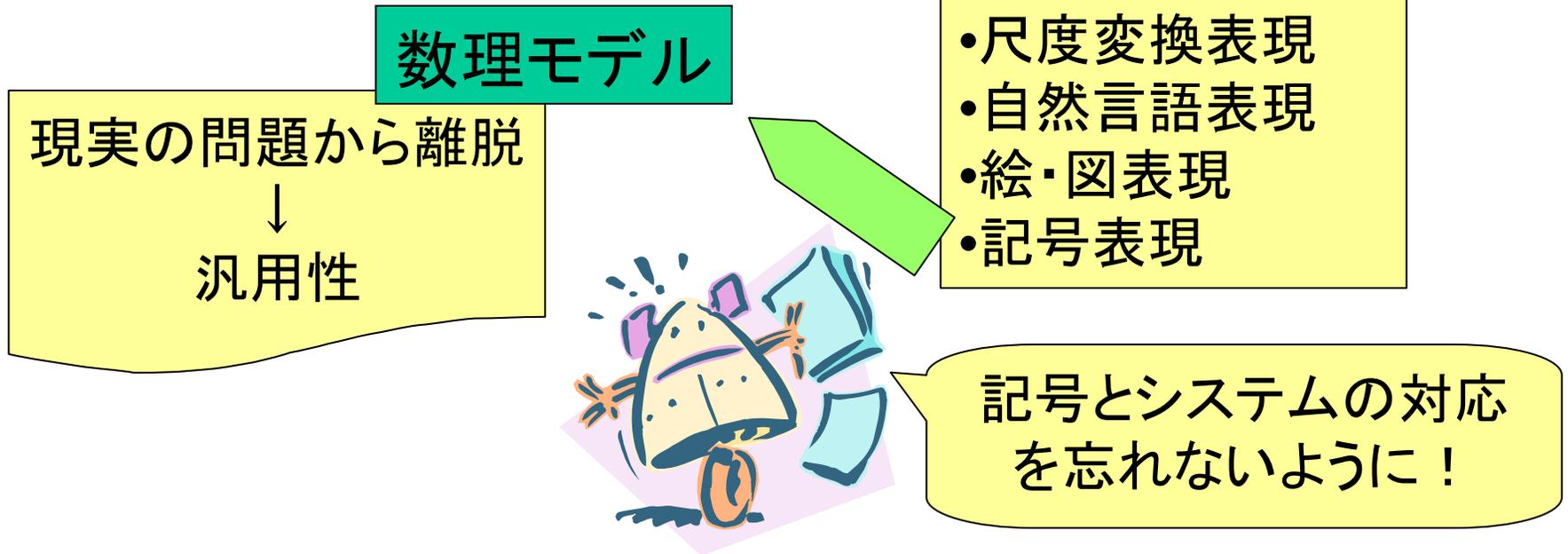
1. 何が問題？
2. システムの構成要素は？相互関係は？
3. コントロールする(できる)構成要素は？
4. コントロールに対する制約は？
5. コントロール結果に対する
良い・悪いの尺度は？



ステップ2 モデル化(定式化)



- 関係部分のみ抽出
- 抽出したシステムを抽象的な記号で表現



数理モデルは便利！

問題A



モデル化

問題B



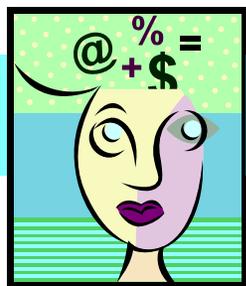
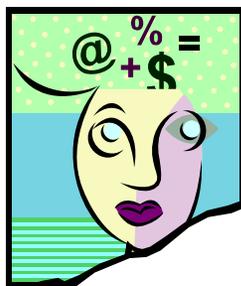
モデル化

問題Z

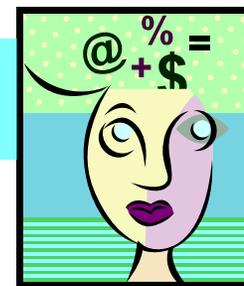


モデル化

様々な問題



同じ構造



数理モデル

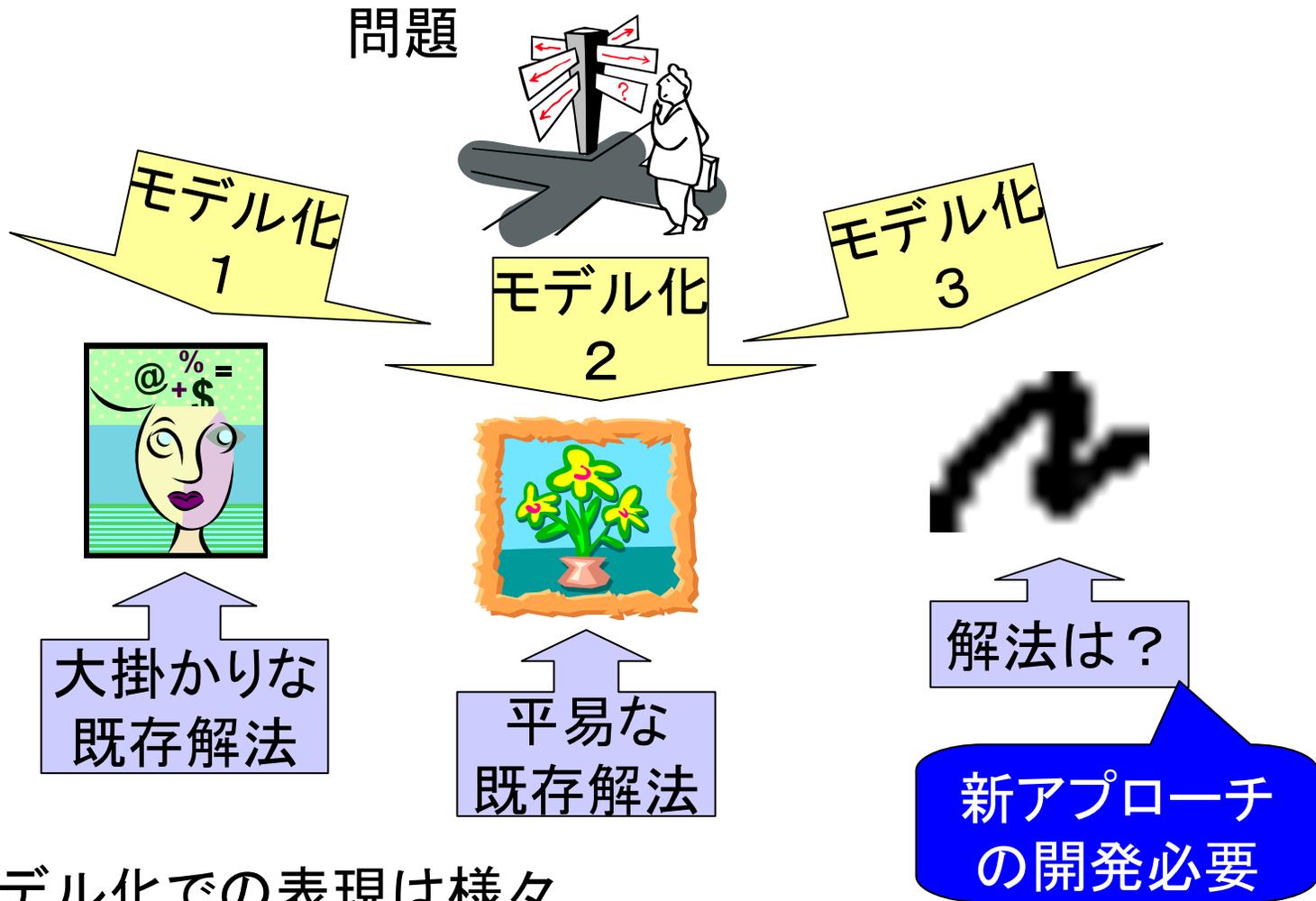
システムの
アプローチ

共通アプローチで解決可

個々に解く必要は
ないんだね



モデル化は芸術

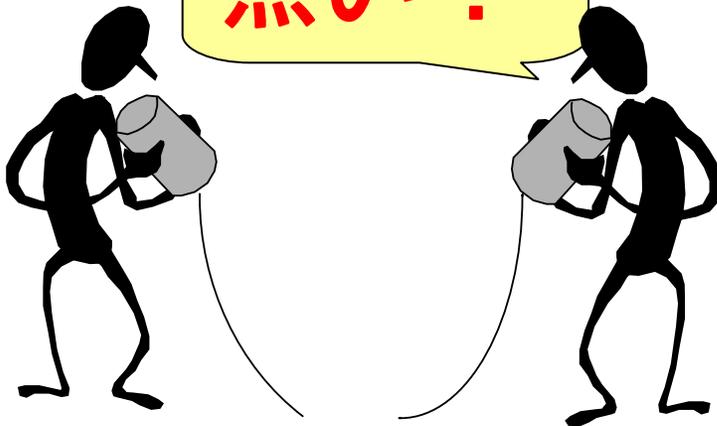


モデル化での表現は様々
⇒表現に応じて解き易い、解きにくい

ステップ3 最適解の導出

数理モデル化された
どんな問題でも解く
万能な方法を教えて

無い！



問題タイプ別の解法

- やさしい手法
- 難しい手法
- 手間のかかる手法
- 効率良い手法 等

数理計画法

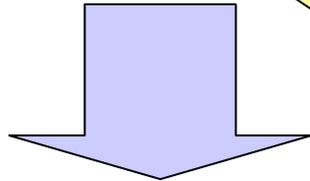
ステップ4 意思決定

数理モデルの最適解

✂

問題解決の最良案

(∵ 元の問題 \supseteq 数理モデル)



ギャップがある
場合が多い

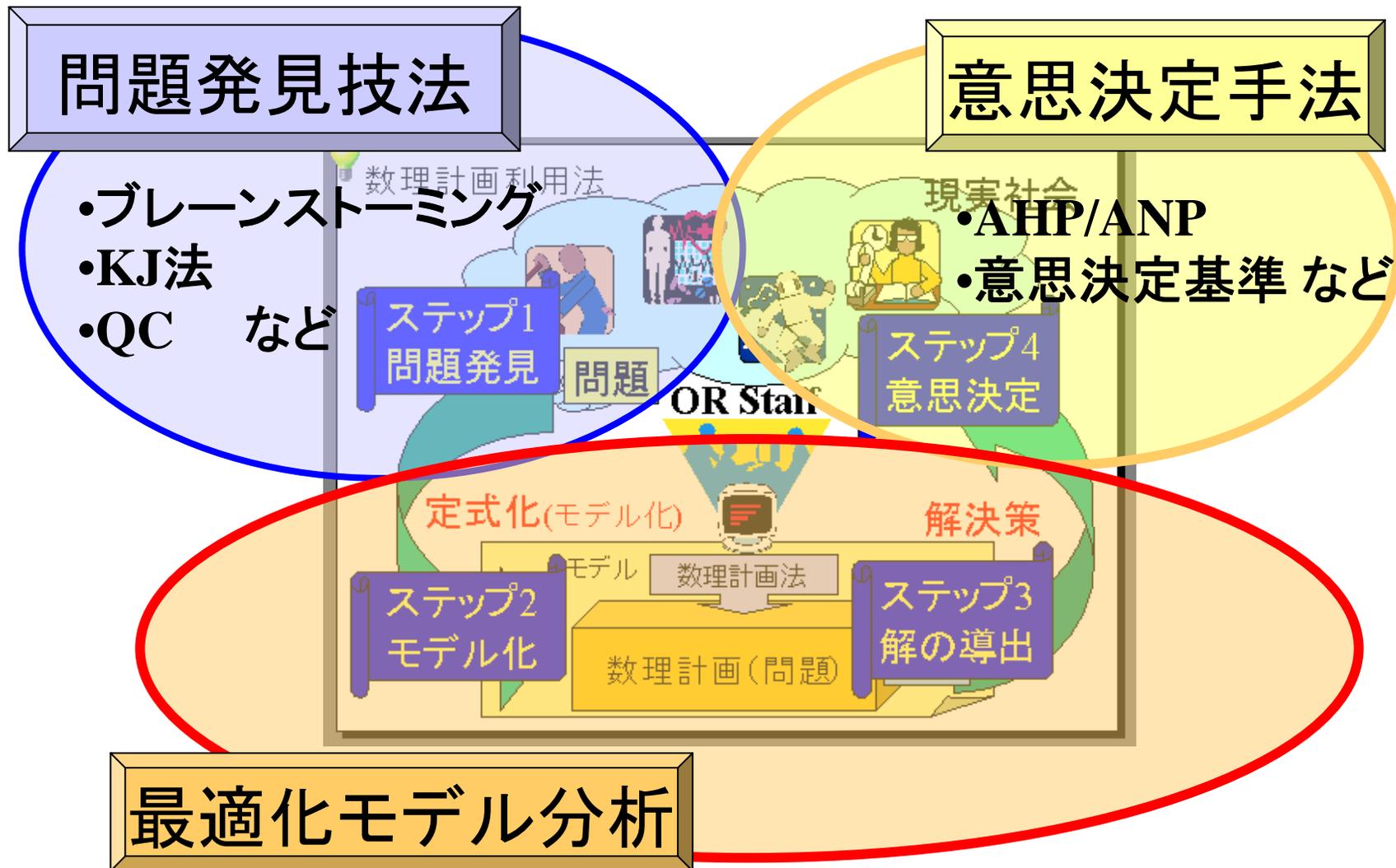


実際の解決策提案には
意思決定が必要

意思決定法

- AHP/ANP
- 意思決定基準 など

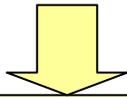
講義「最適化モデル分析」での守備範囲



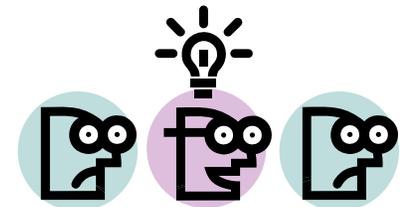
この先で学ぶこと

- 数理計画とは
- システム的アプローチによる問題解決

前半にて学習済



- 数理モデル化と表現方法(定式化)
- 数理計画問題の分類



例題1 数式での表現

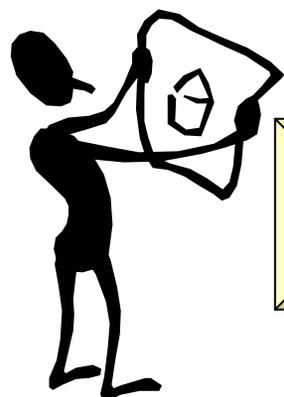
3種類の原液A,B,Cから,
2つの粉末製品P,Qを製造



	製品P 1(kg)	製品Q 1(kg)	使用可能量
原液A	15(kl)	11(kl)	1650(kl/日)
原液B	10(kl)	14(kl)	1400(kl/日)
原液C	9(kl)	20(kl)	1800(kl/日)
利益	5(万円)	4(万円)	

利益が最大になる製品P,Qの1日の生産量は？
問題を数理モデル化しなさい。

数理モデル作成 2つの段階



数理モデル化

問題理解

定式化 formulation

問題表現

観察力・言語理解力

システムとしての把握

- 構成要素は？
 - コントロール可能な要素
 - コントロールできない要素
- 相互関係は？
- コントロール結果の評価方法は？

変数として表現
例： x_1, x_2

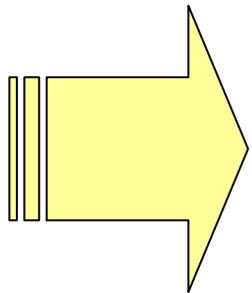
定数として表現

数式として表現
例：等式，不等式

関数として表現

例題1(続) 定式化してみよう

- **コントロールできる要素**: 製品P,Qの生産量
→ 製品Pの生産量を x_1 , 製品Qの生産量を x_2 とおく.
- **コントロールの制約**: 原液A,B,Cの使用可能量
- **コントロール結果の評価**: 利益



- 制約を表す不等式は？
- 利益を表す関数は？

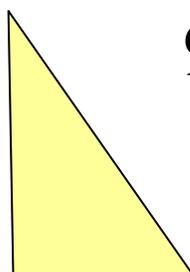


数理計画問題の書き方

目的関数

Objective function

最大化
(最小化の時はminimize)

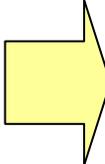

$$\begin{aligned} &\text{maximize } z=5x_1+4x_2 \\ &\text{subject to } 15x_1+11x_2 \leq 1650 \\ &\quad 10x_1+14x_2 \leq 1400 \\ &\quad 9x_1+20x_2 \leq 1800 \\ &\quad x_1 \geq 0 \\ &\quad x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

又は制約条件式
subject to: ~ の条件の下で

制約式

Constraints

省略表記


$$\begin{aligned} &\text{max. } z=5x_1+4x_2 \\ &\text{s.t. } 15x_1+11x_2 \leq 1650 \\ &\quad 10x_1+14x_2 \leq 1400 \\ &\quad 9x_1+20x_2 \leq 1800 \\ &\quad x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

目的関数の $z=$ も
省略される時あり

練習 生産計画



- 2つの液体製品P,Qは機械A,Bを用いて加工される
- 利益が最大になる1週間の製品P,Qの加工量は？

	液体P 1ml	液体Q 1ml	使用可能時間
機械A	3(h)	1(h)	45(h/週)
機械B	1(h)	2(h)	40(h/週)
利益	6(万円)	5(万円)	

⇒ 定式化してみよう

練習 解答例

練習を定式化

x_1 : 液体Pの生産量
 x_2 : 液体Qの生産量

$$\begin{aligned} \max. \quad & z = 6x_1 + 5x_2 \\ \text{s.t.} \quad & 3x_1 + x_2 \leq 45 \\ & x_1 + 2x_2 \leq 40 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

演習2 原料奪取作戦

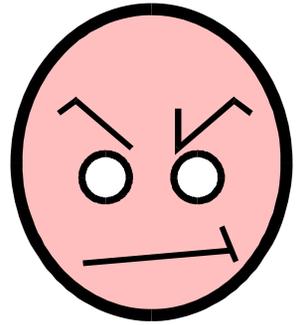


例題1で登場した会社から

- 原液A, B, Cの1日の使用可能量をすべて買い取りたい.
- 支払総額は少なくしたい.
- **問題:各原液1klにいくらで提示する?**

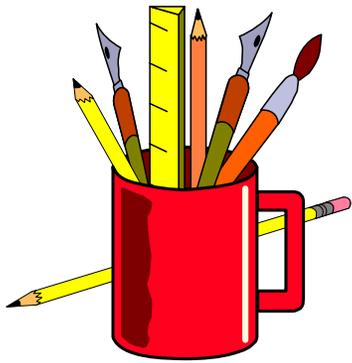
この問題を数理モデルで表現しなさい

演習2(続) ヒント



- **変数**(コントロールできるもの)
 - 原液Aの買取提示価格 y_1 (円/kl)
 - 原液Bの買取提示価格 y_2 (円/kl)
 - 原液Cの買取提示価格 y_3 (円/kl)
- **制約**(交渉成立の条件):
売主は自製造で得る利益以下では売らない
 - 自製造で得る利益以上の金額を提示すべき

数理モデルで表現してみよう！



用語：実行可能解と最適解

optimal solution

最適解：最適値を達成する実行可能解

$$\begin{aligned} \max. \quad & z = 5x_1 + 4x_2 \\ \text{s.t.} \quad & 15x_1 + 11x_2 \leq 1650 \\ & 10x_1 + 14x_2 \leq 1400 \\ & 9x_1 + 20x_2 \leq 1800 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

最適値：目的関数の最大値

optimal value

feasible solution

実行可能解：制約式を満たす (x_1, x_2)

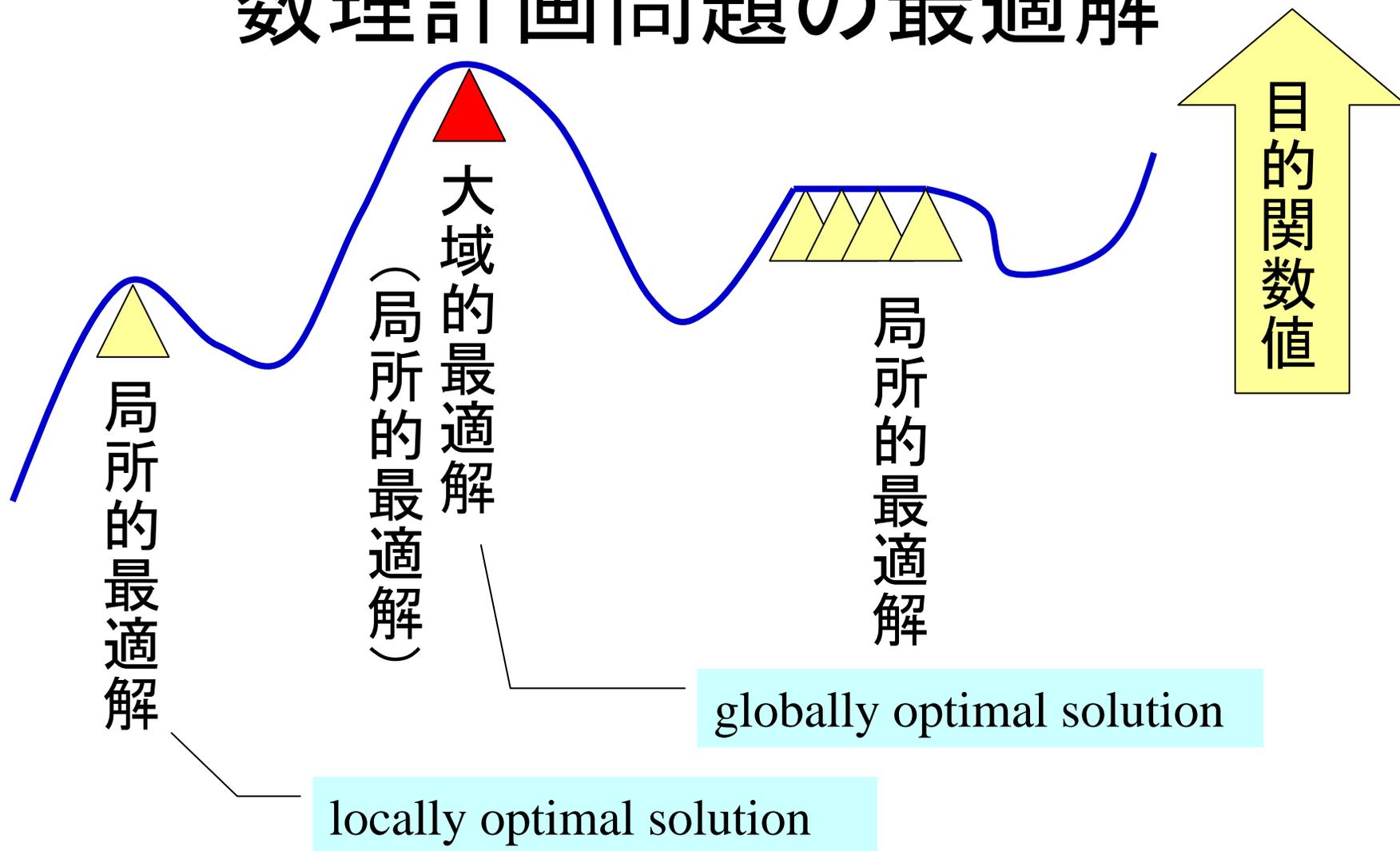
feasible region

実行可能領域：実行可能解の集合

※実行可能解が存在しない場合もある→実行不能な問題

※実行可能でも最適解が存在しない場合がある→例題2

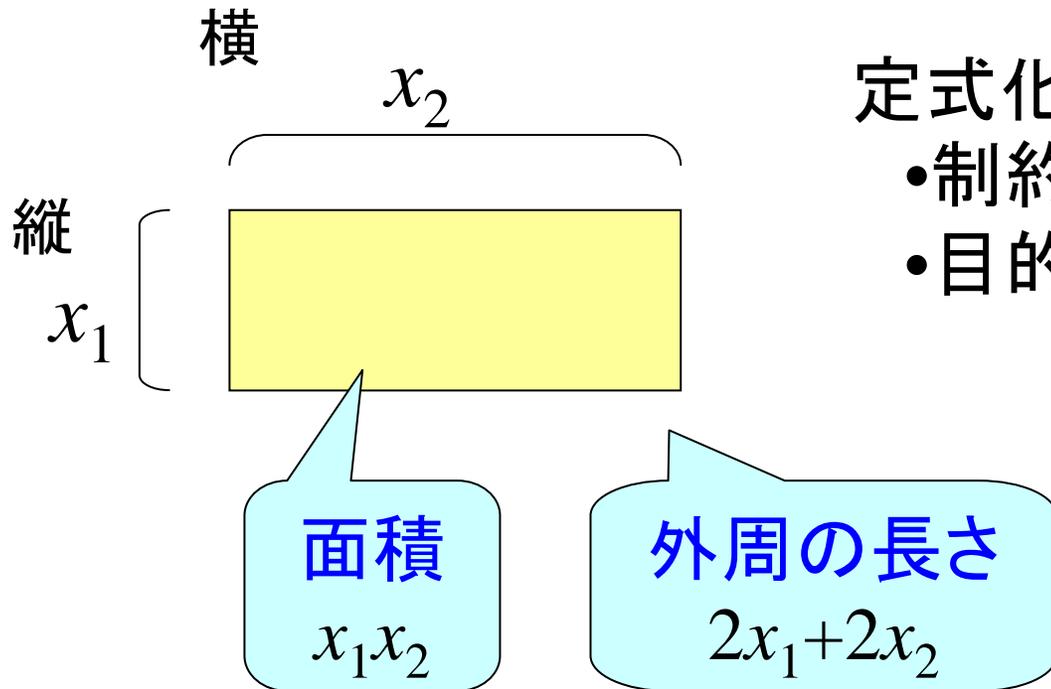
数理計画問題の最適解



※最適解が複数存在する場合もある→通常1つだけ求めればよい

例題2

面積が4以上で，外周の長さ最小の長方形は？



定式化してみよう

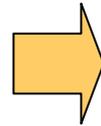
- 制約条件は？
- 目的関数は？



例題2 解答例

- 最適解は $x_1=2, x_2=2$
- 最適値は 8

$$\begin{array}{ll} \min. & z=2x_1+2x_2 \\ \text{s.t.} & x_1x_2 \geq 4 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{array}$$



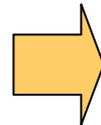
横 $x_2=2$

縦 $x_1=2$

正方形

Q. 面積が4以上で縦の長さ最小の長方形は?

$$\begin{array}{ll} \min. & z=x_1 \\ \text{s.t.} & x_1x_2 \geq 4 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{array}$$

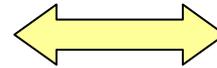


限りなく0に近い値?

⇒最適解はない

最適解が存在する・しない

実行可能領域が存在



実行可能領域が空

最適値は有限

最適値が発散

実行可能解がない



最適解無し

最適解存在

最適解無し

複数存在
も有

例題2
後半の場合

目的関数値を
いくらでも
大きくできる

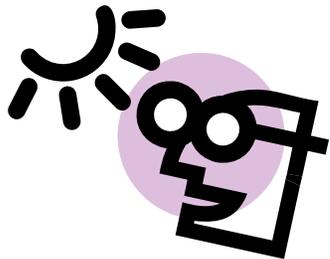
最適解無し

非有界

unbounded

実行不能

infeasible



実行可能解の存在判定

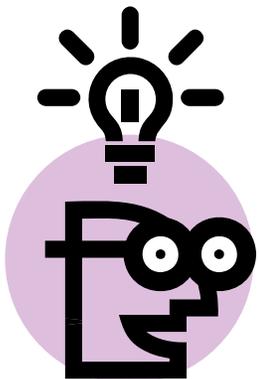
実行可能性問題 feasibility problem

実行可能解が存在するのかを判定する問題

解法: いつでも値が0になる関数を目的関数にする
⇒ 実行可能解があれば, 最適値は0

例

$$\begin{aligned} \max. \quad & z = 0x_1 + 0x_2 \\ \text{s.t.} \quad & 15x_1 + 11x_2 \leq 1650 \\ & 10x_1 + 14x_2 \leq 1400 \\ & 9x_1 + 20x_2 \leq 1800 \\ & x_1, x_2 \geq 0 \end{aligned}$$

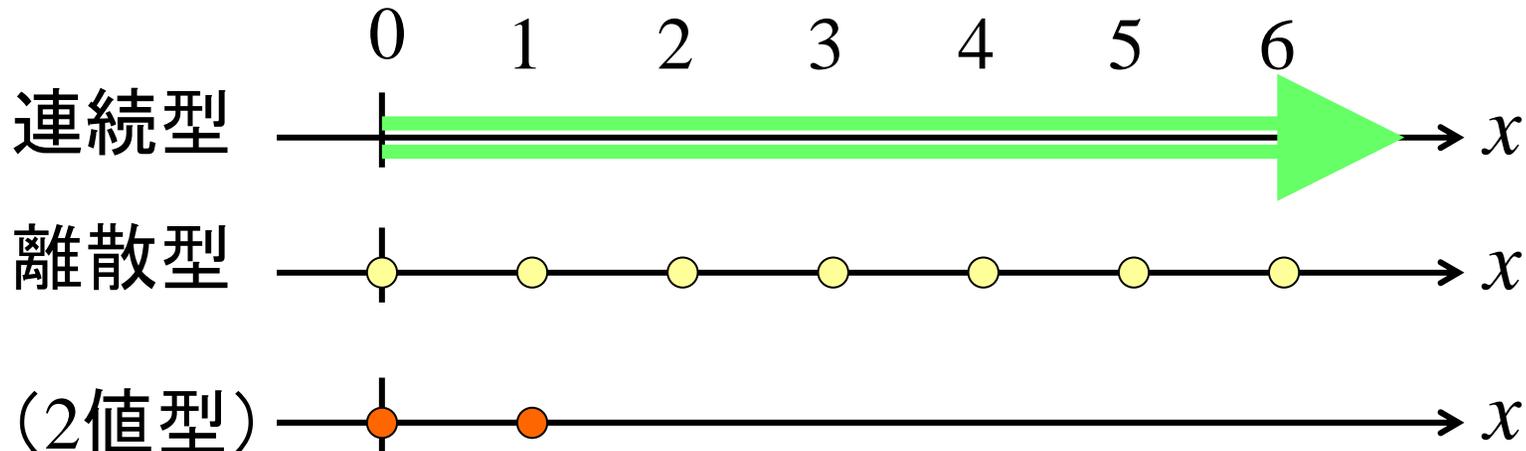


実行可能性の判定
も最適化問題なんだ

定式化の分類法(1)

利用する変数が取れる値の型で分類

- 連続型 continuous \Rightarrow 例: 実数 real
- 離散型 discrete \Rightarrow 例: 整数 integer (整数計画)
 - 2値型 binary \Rightarrow 例: 0または1 (0-1整数計画)



定式化の分類法(2)

使用関数の種類で分類

- 連続関数

- 線形関数 linear

- 非線形関数 nonlinear

- 微分可能 differentiable

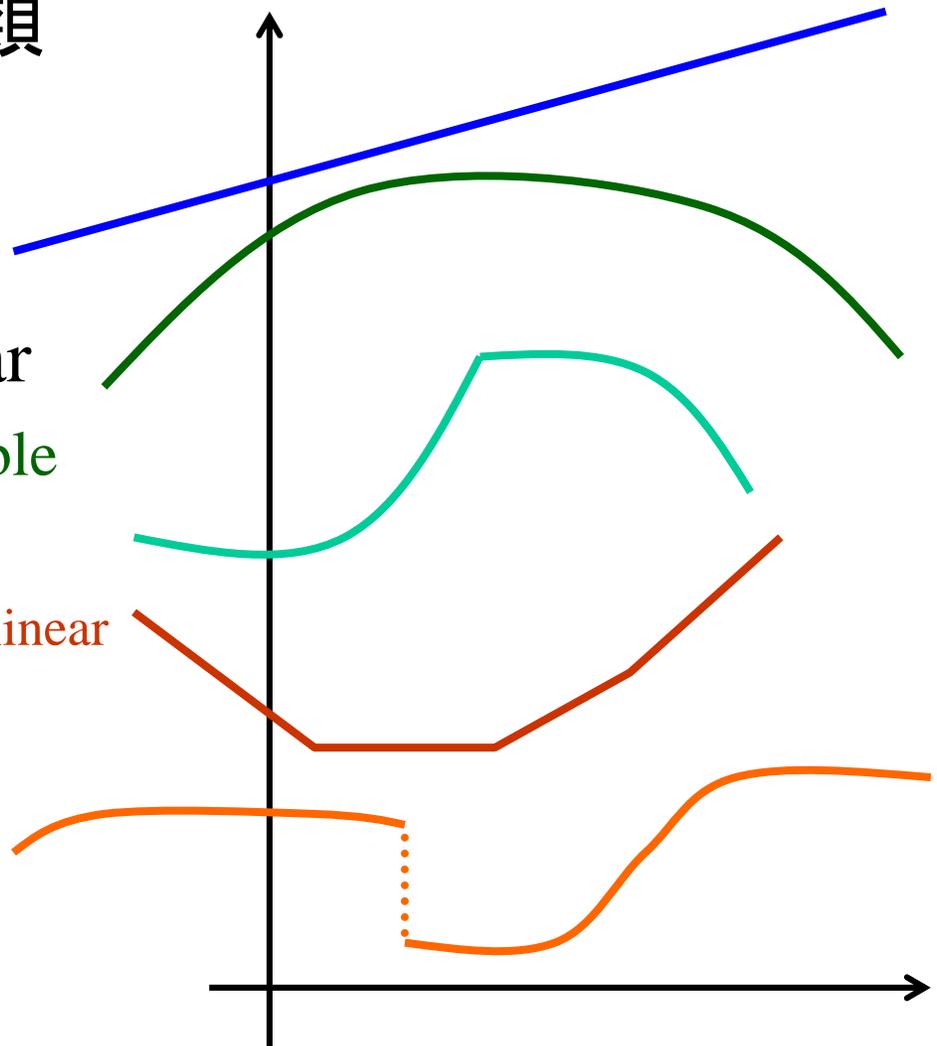
- 微分不能 non-

- 区分線形 piecewise linear

- 非連続

- 凸関数 convex

- 凹関数 concave





分類後の主な問題名

変数型	目的関数	条件式	問題名	+Programming	略称
連続型	線形	線形	線形計画	Linear	LP
	2次関数	線形	2次計画	Quadratic	QP
	凸関数	凸関数	凸計画	Convex	CP
	非線形	非線形	非線形計画	Nonlinear	NLP
離散型	—	—	整数計画	Integer	IP
	凸	凸	離散凸計画	Discrete Convex	
2値型	—	—	0-1整数計画	Binary Integer	BIP
混合	—	—	混合整数計画	Mixed Integer	MIP

※ 凸計画の等式制約は線形

例題3 ナップザック問題



自由にお持ち
帰りください

16万円



19万円



23万円



28万円



重量制限: 7kg

なるべく総価値を高く持って帰りたい。
どれを何kg持って帰る?

⇒定式化してみよう

8万円/kg

19/3万円/kg

5.75万円/kg

5.6万円/kg

単位価値額

6.3

16万円

19万円

23万円

28万円



x_1 kg

x_2 kg

x_3 kg

x_4 kg

例題3(続)
分割可の時

変数: 積む量

線形計画

$$\max. z = 8x_1 + 19/3x_2 + 5.75x_3 + 5.6x_4$$

$$\text{s.t. } x_1 + x_2 + x_3 + x_4 \leq 7$$

$$x_1 \leq 2, x_2 \leq 3, x_3 \leq 4, x_4 \leq 5,$$

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

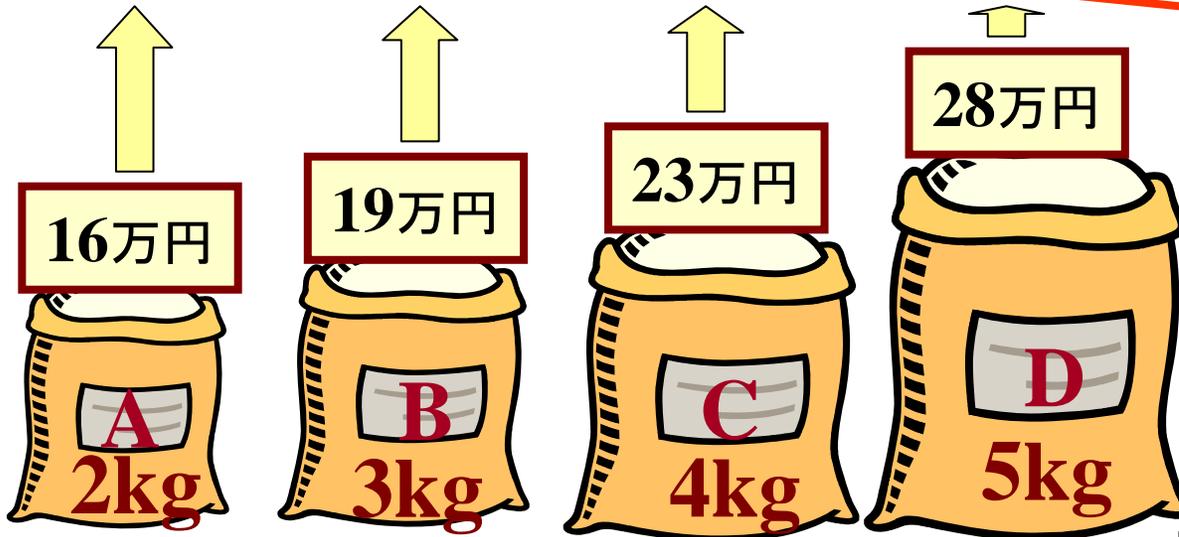
~~8万円/kg~~

~~6.3万円/kg~~

~~5.7万円/kg~~

~~5.6万円/kg~~

~~単位価値額~~



例題3(続) 分割不可の時

2値(0-1)変数

x_1

x_2

x_3

x_4

0-1整数計画

$$\max. z = 16x_1 + 19x_2 + 23x_3 + 28x_4$$

$$\text{s.t.} \quad 2x_1 + 3x_2 + 4x_3 + 5x_4 \leq 7$$

$$x_1, x_2, x_3, x_4 \in \{0, 1\}$$

積む時: $x=1$

積まない時: $x=0$

記号 \in

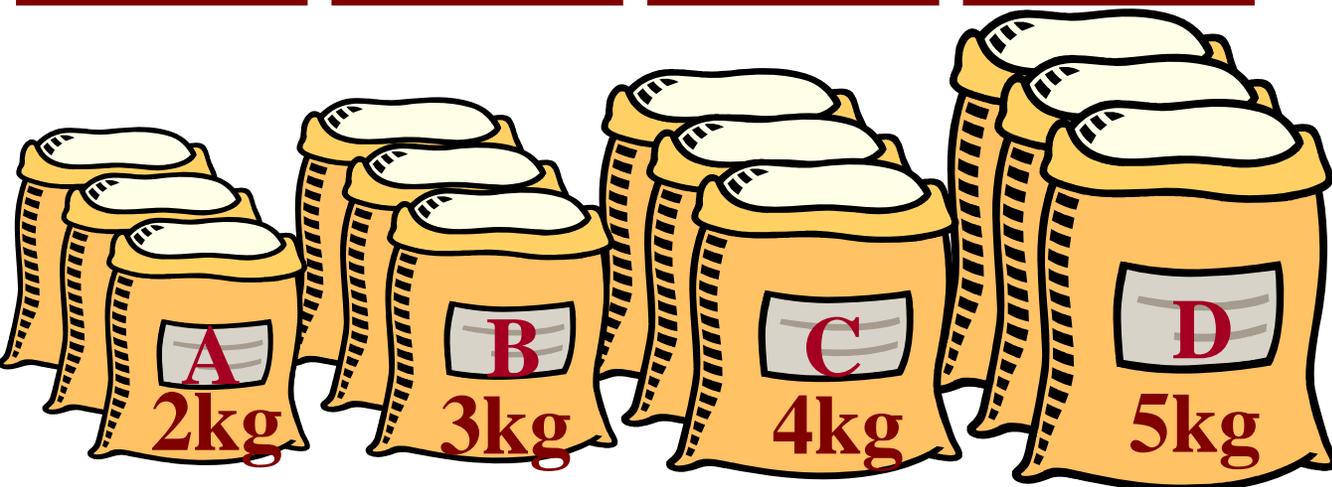
元として含まれる

16万円/袋

19万円/袋

23万円/袋

28万円/袋



x_1 袋

x_2 袋

x_3 袋

x_4 袋

整数計画

$$\max. z = 16x_1 + 19x_2 + 23x_3 + 28x_4$$

$$\text{s.t.} \quad 2x_1 + 3x_2 + 4x_3 + 5x_4 \leq 7$$

$$x_1, x_2, x_3, x_4 \in \mathbb{Z}_+$$

例題3(続)
分割不可
複数可の時

変数: いくつ積む?

記号 \mathbb{Z}_+

非負整数の集合

(参考) \mathbb{R} : 実数

\mathbb{Z}_+ : 正の整数

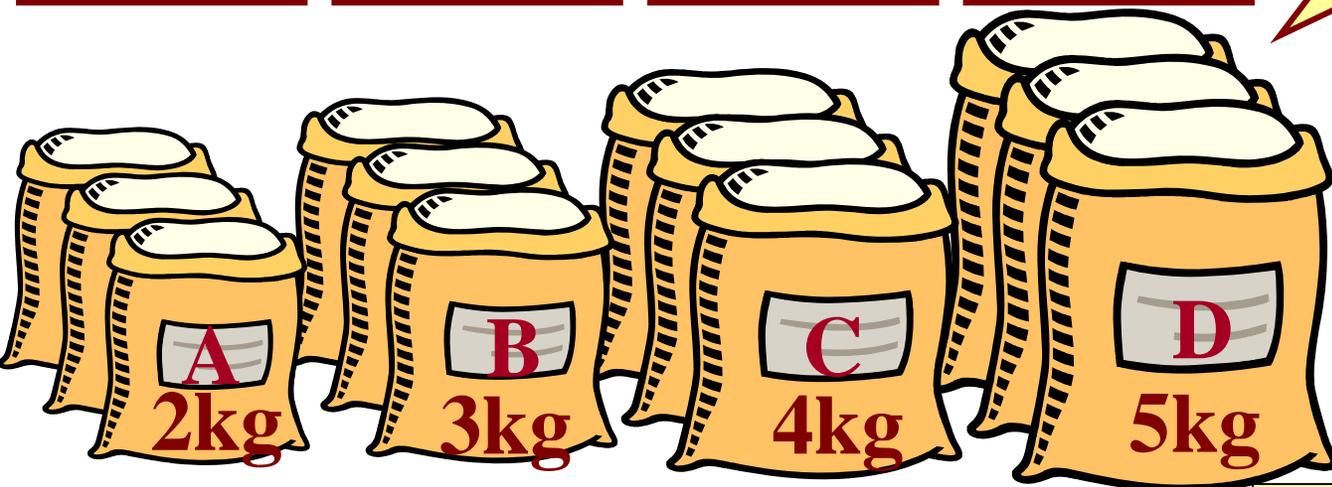
16万円/袋

19万円/袋

23万円/袋

28万円/袋

Dのみ分割可



例題3(続)
分割一部可
複数可の時

x_1 袋

x_2 袋

x_3 袋

x_4 袋

変数: 何袋分積む?

混合整数計画

変数: 何袋積む?

$$\max. z = 16x_1 + 19x_2 + 23x_3 + 28x_4$$

$$\text{s.t.} \quad 2x_1 + 3x_2 + 4x_3 + 5x_4 \leq 7$$

$$x_1, x_2, x_3 \in \mathbb{Z}_+, \quad x_4 \geq 0$$

例題3(続) 分割不可の時(別表現1)

2kg, 3kg, 4kg, 5kg

カートの重量制限 (kg)

対象の粉を順に増やす

	0	1	2	3	4	5	6	7
なし	0	0	0	0	0	0	0	0
	0	0	16	16	16	16	16	16
	0	0	16	19	19	35	35	35
	0	0	16	19	23	35	39	42
	0	0	16	19	23	35	39	44

16万, 19万, 23万, 28万

例題3(続) 動的計画法

カートの重量制限



	0	1	2	3	4	5	6	7
0	0	0	16	19	19	35	35	35
↓ +23	0	0	16	19	23	35	39	42

粉がk種類, カートの制限重量が α kgの時の最適値

制限重量 α が粉kの重み以下のとき

$$f(k, \alpha) = \begin{cases} f(k-1, \alpha) & \text{粉kを積まない} \\ \max\{f(k-1, \alpha), (k\text{の価値}) + f(k-1, \alpha - (k\text{の重み}))\} & \text{粉kを積む} \end{cases}$$

比較して, 価値の高い方を採用

再帰方程式

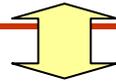
動的計画法 Dynamic Programming (DP)

例題4 ガス管配置

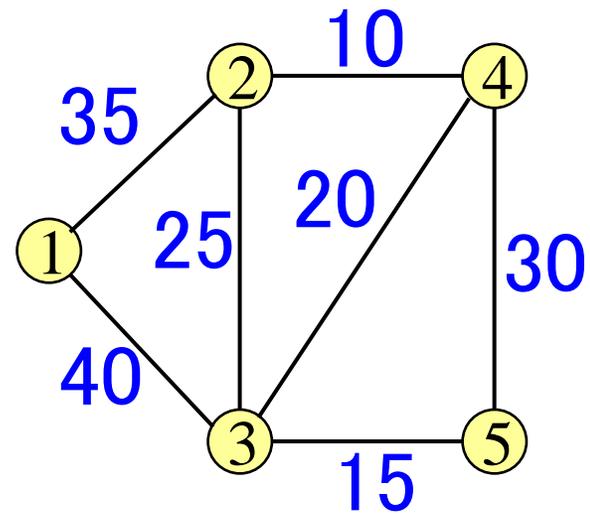
5軒の家にガスを供給したい
設置費用が最小になるガス
管の設置方法は?

定式化してみよう

目的 設置費用合計→最小
制約 5軒にガスを供給



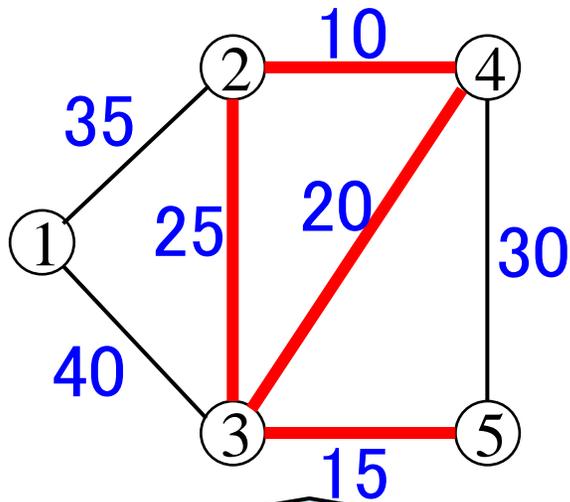
ガス管が繋がっている+5軒を張っている



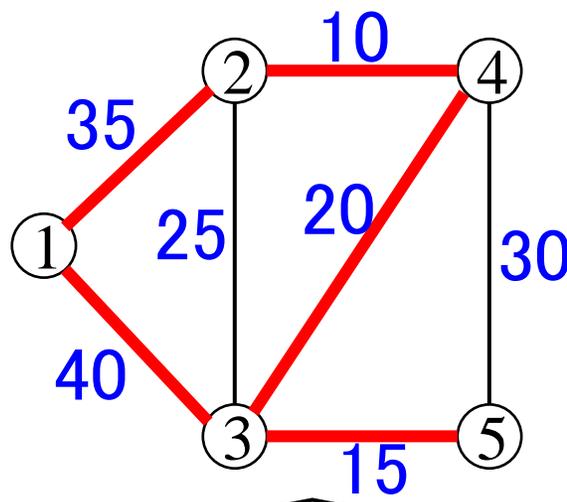
枝: 設置可能路線
数字: 設置費用

例題4(続) 最適解でない例

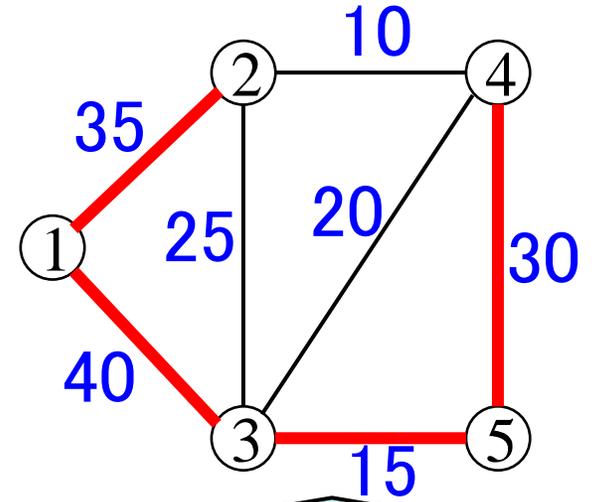
なぜ最適でないのか？



条件を満たしていない



自明な無駄がある



他に良いプランがある

改善策

実行不能

閉路は無駄
× 閉路上の最大重み枝

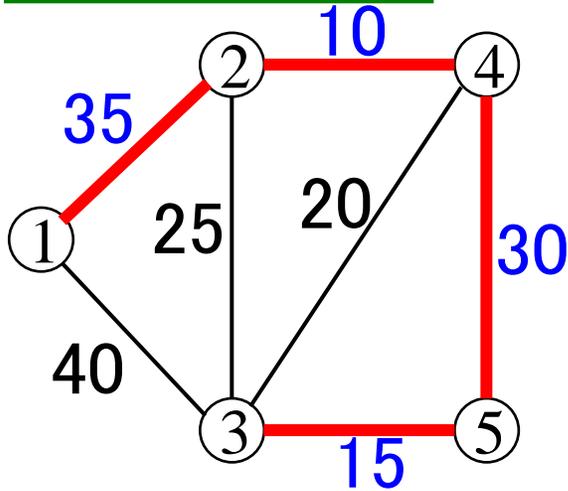
非連結部分を繋げる
○ 最小重み枝

例題4(続) 実行可能解が持つ性質

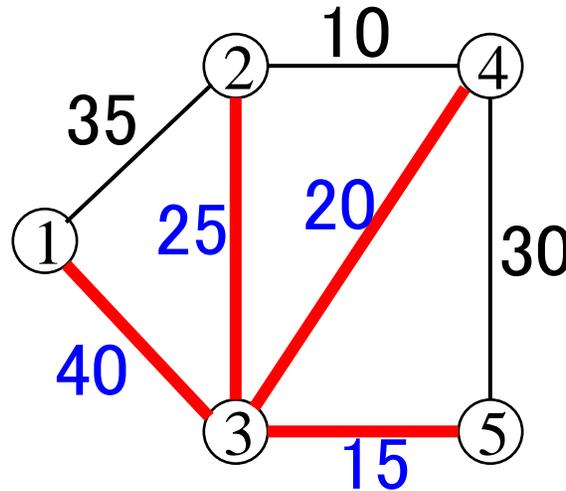
閉路は無駄 ⇒ 閉路の無いグラフ = 木
全点を結ぶ ⇒ 全張 (spanning; スパンする)

} 全張木
spanning tree

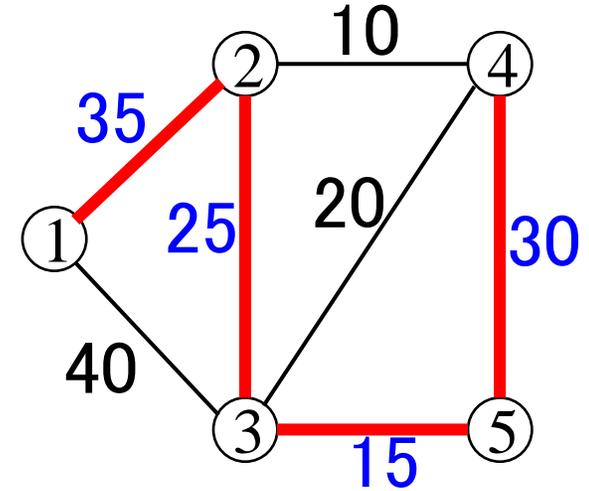
様々な全張木



$$35+10+30+15=90$$



$$40+25+20+15=100$$



$$35+25+30+15=105$$

問題の本質 重み和最小の全張木 (最小木) を見つけよ

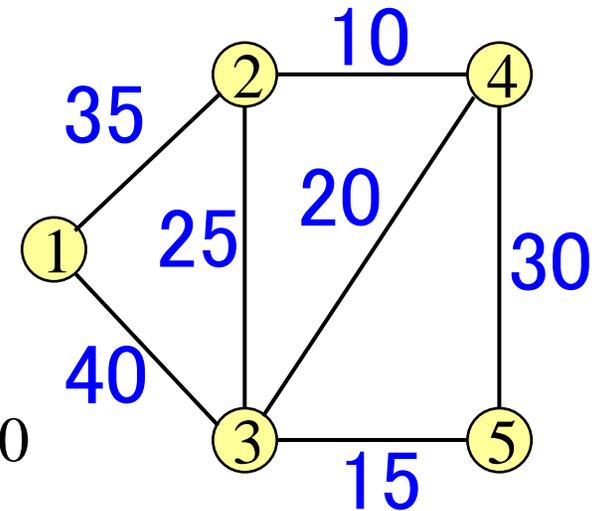
⇔ 最小木問題

Minimum spanning tree problem

例題4(続) 最小木問題の定式化

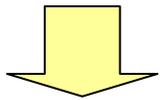
解きたい問題

目的 利用枝の重みの和→最小
制約 利用枝は全点を結ぶ
利用枝に閉路がない



使用変数

x_{ij} : 枝 (i,j) を利用する時1, 利用しない時0



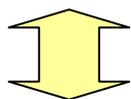
目的関数

$$\min. z = 35x_{12} + 40x_{13} + 25x_{23} + 10x_{24} + 20x_{34} + 15x_{35} + 30x_{45}$$

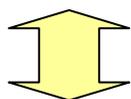
⇒ 制約条件式は?

例題4(続)「閉路がない」の表現

閉路がない



(部分点集合内での使用枝数)
 $<$ (部分点集合の大きさ)

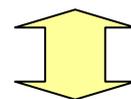


(部分点集合内での使用枝数)
 \leq (部分点集合の大きさ) $- 1$

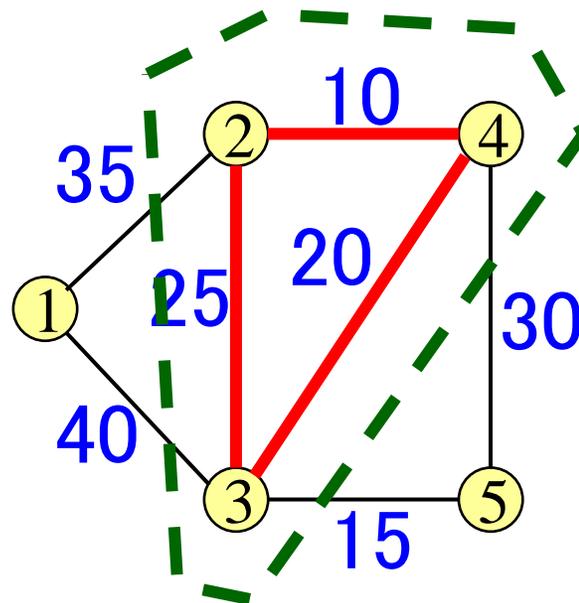
例 点部分集合 $\{②,③,④\}$ に対して

$$x_{23} + x_{24} + x_{34} \leq 2$$

閉路がある



(部分点集合内での使用枝数)
 $=$ (部分点集合の大きさ)



例題4(続) 定式化

$$\min. z=35x_{12}+40x_{13}+25x_{23}+10x_{24}+20x_{34}+15x_{35}+30x_{45}$$

$$\text{s.t. } x_{12}+x_{13}+x_{23}+x_{24}+x_{34}+x_{35}+x_{45}=4$$

全部分集合に対して

$$(\text{使用枝本数}) \leq (\text{部分集合の大きさ}) - 1$$

$$x_{12}, x_{13}, x_{23}, x_{24}, x_{34}, x_{35}, x_{45} \in \{0, 1\}$$

定式化は可能だが
サイズ大で実際には扱えない

部分集合は $2^{(\text{点数})}$ 個存在

⇒ 使用枝の組合せを決める問題

⇒ **組合せ最適化問題** combinatorial optimization problem

離散最適化問題 discrete optimization problem

定式化を利用しない

最小木の見つけ方: アイディア(1)

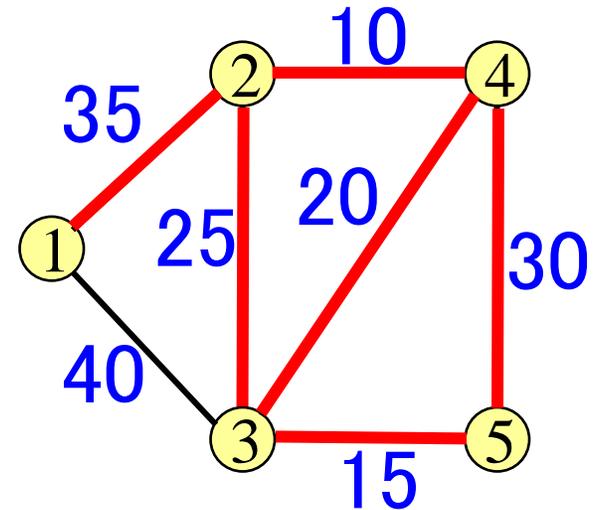
閉路⇒最大重みの枝を消去

↓ 実現方法例

重みの小さい順に枝を選択し
閉路になる時は選ばない
全点がつながったら終了

クラスカル法

(Kruskal)



定式化を利用しない

最小木の見つけ方: アイディア(2)

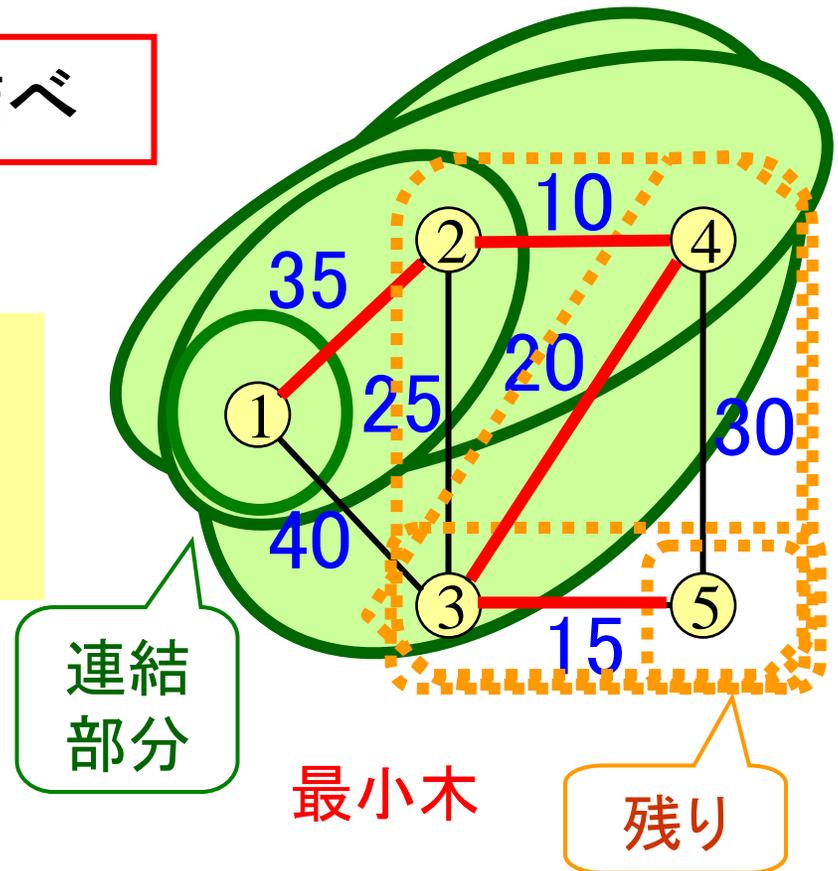
非連結⇒最小重みの枝で結べ

↓ 実現方法例

1点から連結部分を1点ずつ
最小重みの枝で増やす
全点が連結になったら終了

プリム法

(Prim)



最小木問題に対する解法の計算量

n : グラフの点数
 m : グラフの枝数

クラスカル法

- 閉路の発見に集合の併合操作 $O(m+n\log n)$
- データ構造の改造で $O(m\alpha(m,n)) + O(m\log n)$

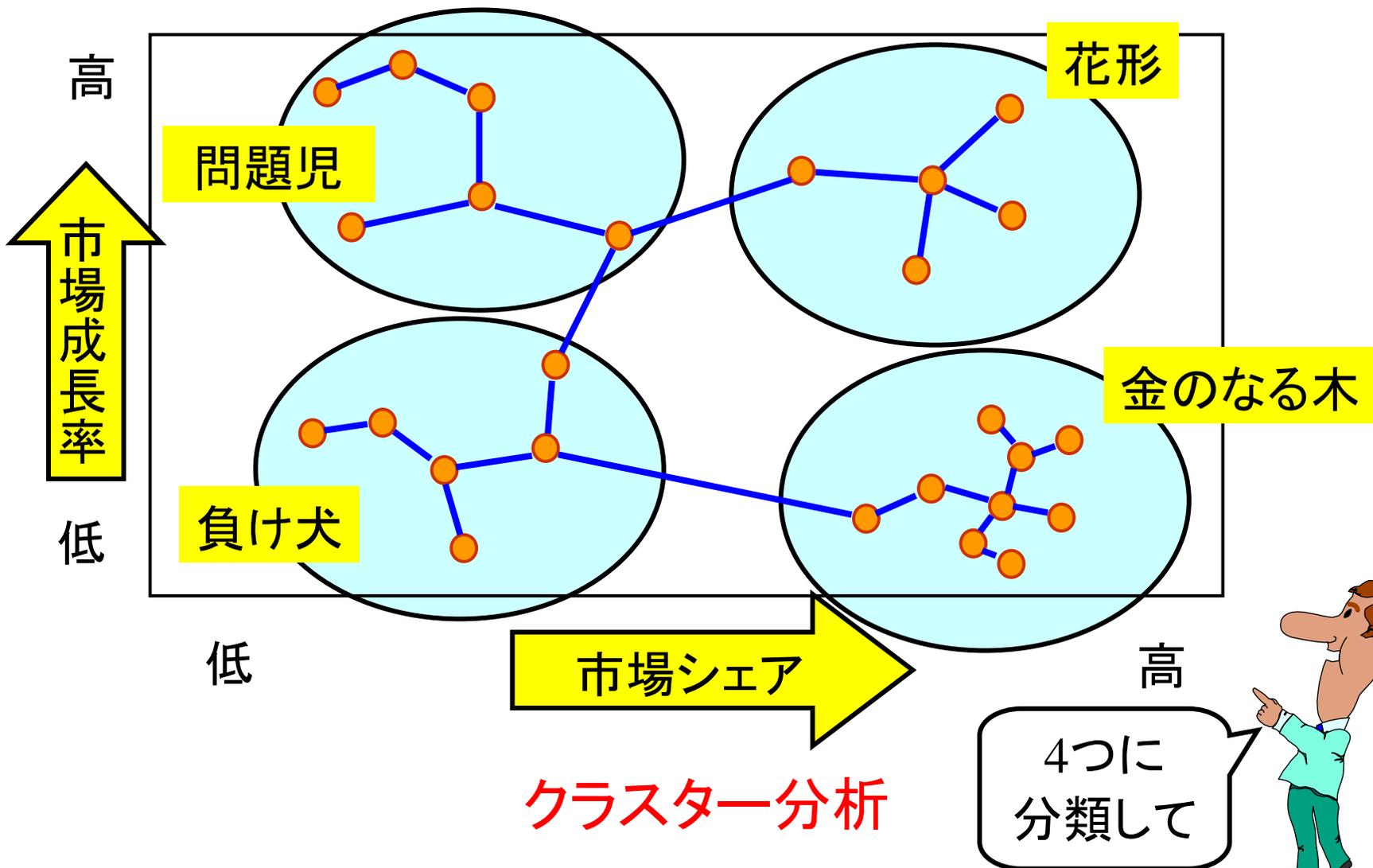
Ackermann逆関数

プリム法

- $O(n^2) \Rightarrow$ Fibonacciヒープの利用 $O(m+n\log n)$
- 改良 $O(m\beta(m,n)) \Rightarrow$ さらに改良 $O(m\log\beta(m,n))$

▶ $O(m)$ 線形時間解法はあるか? ◎存在確認
◎平面グラフ

最小木問題の利用例





演習3 定式化せよ

施設配置問題

(建設費) + (配送費)を最小にしたい。
どこに倉庫を建設し、
どのように配送すればよいか。
この問題を定式化せよ。

倉庫候補地

③

店

1

①

2

②

- 倉庫*i*の建設費用 f_i ($i=1,2$)
- 倉庫*i*と店*j*間の配送費用 c_{ij} ($i=1,2; j=1,2,3$)
- 各店の需要は1. 分割配送可能.

ヒント ↓

コントロールできるもの

倉庫*i*から店*j*への配送量 $\Rightarrow 0 \sim 1$ の値

倉庫*i*を建設する・しない $\Rightarrow 2$ 値

$$0 \leq x_{ij} \leq 1$$

$$y_i \in \{0,1\}$$

さて今後の展開は



最もシンプルな数理計画問題

＝線形計画問題の最適解の導出法を考える



寄り道 組合せ最適化

◎ 組み合わせる(動詞)

意味が違う

- × 組み合わせ最適化
- × 組合わせ最適化
- × 組合最適化

