

INVESTIGAÇÃO OPERACIONAL

Programação Linear

Exercícios

Cap. X – Programação por Metas

António Carlos Morais da Silva
Professor de I.O.

X. Programação por Metas

1. Considere o modelo de PL:

$$\text{Max } f(X) = 6x_1 + 8x_2 \quad (\text{lucro da venda de mesas e cadeiras})$$

s.a.

$$\begin{array}{rcll} x_1 & & \geq & 30 \quad (\text{produção de mesas}) \\ & x_2 & \geq & 10 \quad (\text{produção de cadeiras}) \\ x_1 & + & 2x_2 & \leq 40 \quad (\text{operários}) \\ & x_1, x_2 & \geq & 0 \text{ e Inteiro} \end{array}$$

O problema não tem solução admissível pois os operários não são suficientes para satisfazer a produção mínima de mesas e cadeiras (seriam necessários, pelo menos, $30 + 20 = 50$ operários).

Para ultrapassar a situação admita que as produções mínimas de mesas e cadeiras passam a constituir “metas” da empresa mantendo-se a maximização do lucro como critério de avaliação das soluções admissíveis.

Formalize como problema de metas e calcule a solução ótima.

2. Uma empresa produz três bens A, B e C em quantidades x_1 , x_2 e x_3 sendo as funções de lucro e de emprego da mão-de-obra as seguintes:

- $g_1(X) = 12x_1 + 18x_2 + 15x_3$ (lucro)
- $g_2(X) = 2x_1 + 6x_2 + 5x_3$ (mão-de-obra)

As restrições técnicas a cumprir são as seguintes:

- horas/máquina : $2x_1 + 3x_2 + 2x_3 \leq 90$
- produção de A: igual ao dobro da produção de B
- produção de C: pelo menos o dobro da produção de A

O decisor pretende estudar a produção com as seguintes preferências:

- manter a mão-de-obra ao nível de 150 operários
- estabelecer como critério de avaliação de soluções a maximização de $2g_1(X) - 5g_2(X)$

Formalize como problema de metas e calcule a solução ótima.

3. Considere o seguinte modelo de PL para minimização de custos de produção:

$$\text{Min } f(X) = f_1(x_1) + f_2(x_2)$$

s.a.

$$x_1 + 2x_2 \leq 9$$

$$2x_1 + 3x_2 \geq 9$$

O decisor pretende a optimização dos custos tendo em consideração o seguinte:

$$f_1(x_1) = \begin{cases} 3x_1 & \text{para } x_1 \geq 0 \\ x_1 & \text{para } x_1 \leq 0 \end{cases}$$

$$f_2(x_2) = \begin{cases} 4x_2 & \text{para } x_2 \geq 0 \\ 3x_2 & \text{para } x_2 \leq 0 \end{cases}$$

Formalize como problema de metas e calcule a solução óptima.

4. Considere a produção de A e B de acordo com os seguintes dados:

	A	B	Meta	Prioridade
Capital (u.m.)	1	2	≤ 20	1ª
Pessoal	1	1	$= 15$	2ª
Lucro unitário (u.m.)	2	1	≥ 40	3ª

Formalize como problema de metas e calcule a solução óptima pelo método do Simplex modificado para Metas.

5. Apresente as alterações que introduziu, no método do Simplex usual, para resolver o problema anterior.
6. No Simplex modificado para Metas como detecta soluções óptimas alternativas?
7. Calcule a solução do problema 10.4 usando, no cálculo, um único objectivo ("Big M's").
8. Considere a produção de mesas e cadeiras de acordo com o seguinte:

	Mesa	Cadeira	Disponibilidade
Madeira (m²)	30	20	300
Horas de trabalho	5	10	110
Treino do pessoal (horas)	1	3	
Receita da venda (u.m.)	50	25	
Lucro de venda (u.m.)	6	8	

O decisor pretende uma solução de compromisso que satisfaça simultaneamente:

- lucro mínimo de 90 u.m.
- receita da venda não inferior a 450 u.m.
- treino do pessoal com mínimo de 30 horas

Formalize como problema de metas e calcule a solução óptima.

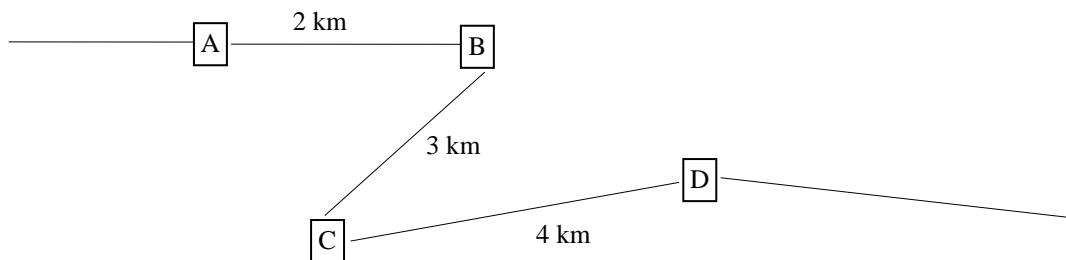
9. Considere o aumento do problema anterior com as seguintes preferências e prioridades do decisor:

	Mesa	Cadeira
Investimento de capital (u.m.)	44	17
Pelo menos 4 cadeiras por mesa produzida		

Não ultrapassando 325 u.m. de investimento, adaptar o modelo anterior e calcular a solução óptima com as seguintes prioridades (ordem decrescente):

Lucro , Cadeiras / mesas , Capital , Receita , Treino

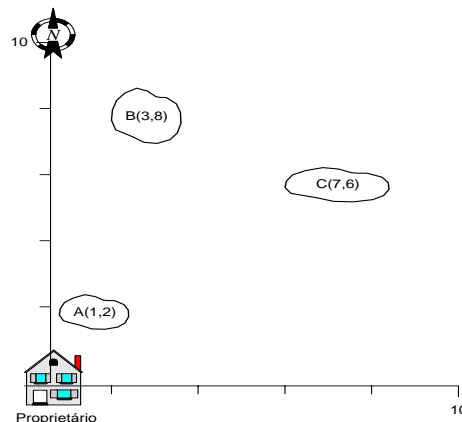
10. Admita que uma gasolinheira pretende instalar uma estação de serviço tendo como potenciais clientes os habitantes das localidades situadas no seguinte conjunto rodoviário:



Nas localidades A, B, C e D estão recenseadas 100, 400, 200 e 300 viaturas respectivamente devendo o local escolhido minimizar o produto do número de viaturas recenseadas pela distância das localidades à estação de serviço.

Formalize como problema de metas e calcule a solução óptima.

11. O proprietário de uma herdade necessitando reforçar a capacidade de rega de três terrenos A, B e C decidiu efectuar um furo. A ligação deste aos terrenos será feita por tubagens instaladas exclusivamente nas direcções Norte-Sul e/ou Este-Oeste para facilitar o emprego de máquinas agrícolas sem destruição de tubagens. As áreas de A, B e C são, respectivamente, 100, 300 e 200 hectares e a sua posição relativamente à casa do proprietário é a seguinte (eixos graduados em km):



Sendo o critério de localização "minimizar a soma dos produtos obtidos multiplicando a área de cada terreno pelo comprimento da tubagem que o liga ao furo", calcule o conjunto óptimo de tubagens a instalar.

12. Admita que para dactilografar na próxima semana, um documento com 1000 páginas, contactou 4 empresas (A, B, C, D) que prestam este serviço e recolheu a informação seguinte:

Empresa	Custo/página (u.m.)	Nº páginas/hora	Erros/página	Horas disponíveis (próxima semana)
A	3.5	6.4	0.015	50
B	2.4	5.2	0.018	40
C	3.75	7.5	0.008	50
D	3.9	8.8	0.012	35

Não sendo possível que uma única empresa efectue o trabalho na próxima semana, admita o recurso a mais do que uma delas considerando os seguintes critérios e prioridades:

- 1ª prioridade: trabalho executado no prazo de uma semana
- 2ª prioridade: não ter mais do que 12 erros no total das 1000 páginas
- 3ª prioridade: não gastar mais do que 3000 u.m.

Formalize como problema de metas e calcule a solução óptima.

INVESTIGAÇÃO OPERACIONAL

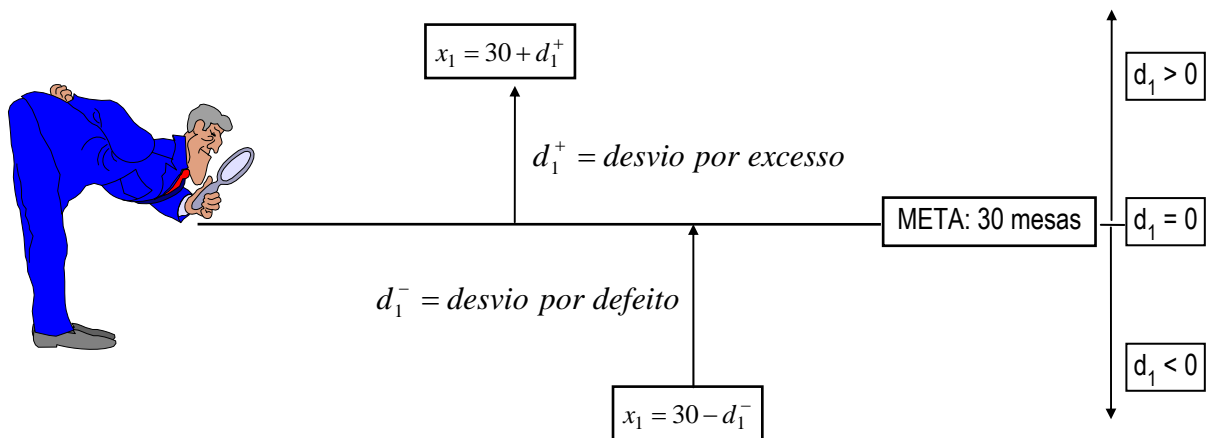
Programação Linear

Soluções dos Exercícios

Cap. X – Programação por Metas

António Carlos Morais da Silva
Professor de I.O.

1. A produção mínima de 30 mesas, inicialmente imperativa, passa a ser a "meta" $x_1 = 30 + d_1$ em que "d1" é uma variável de desvio (livre). Esta variável pode ser substituída pela diferença entre duas variáveis não negativas associadas aos "desvios por excesso e defeito" respectivamente (ver figura).



A figura evidencia que a restrição inicial $x_1 \geq 30$ deve ser substituída pela Meta,

$$x_1 - d_1^+ + d_1^- = 30$$

Trata-se de uma relação que não é uma restrição técnica pois não restringe o espaço de soluções.

Se, por exemplo, a variável x_1 tiver valor 5, diz-se que a "Meta é cumprida por Defeito" pois a igualdade será satisfeita com $d_1^- = 25$ (notar que as duas variáveis de desvio são complementares, ou seja o seu produto é sempre nulo).

Se o decisor "deseja" $x_1 \geq 30$ está disponível para "ceder" perante um valor inferior (que pode limitar se achar necessário).

A adoção de "Metas" em vez de restrições técnicas conduz a obter uma solução de compromisso, ou seja, a melhor solução que a estrutura do modelo pode gerar.

Quando o modelo linear envolve "Metas" é de interesse organizar um quadro com as mesmas e identificar os desvios indesejáveis e a ponderação a associar-lhes.

No exemplo em curso temos então:

Descrição	Preferência do decisor	Equação da Meta	Desvios Penalizáveis
Produção de mesas	$x_1 \geq 30$	$x_1 - d_1^+ + d_1^- = 30$	Defeito (d_1^-)
Produção de cadeiras	$x_2 \geq 10$	$x_2 - d_2^+ + d_2^- = 10$	Defeito (d_2^-)

Notar que na 1ª meta o "desvio por defeito d_1^- " deve ter o menor valor possível para que a produção fique tão próximo quanto possível da produção desejada de 30 mesas.

De igual modo, na 2ª meta, o "desvio por defeito d_2^- " deve ter o menor valor possível para que a produção fique tão próximo quanto possível da produção desejada de 10 cadeiras.

O modelo inicial deve pois ser substituído pelo modelo seguinte:

$$\text{Min } f(D) = 6d_1^- + 8d_2^- \quad (\text{minimizar a perda de lucro})$$

s.a.

$$x_1 - d_1^+ + d_1^- = 30$$

$$x_2 - d_2^+ + d_2^- = 10$$

$$x_1 + 2x_2 \leq 40$$

$$x_1, x_2, d_1^+, d_1^-, d_2^+, d_2^- \geq 0 \text{ e Inteiro}$$

A função $f(D)$ minimiza a perda de lucro associada aos “desvios por defeito” (veja-se que para 1 mesa abaixo da meta a redução do lucro é de 6 u.m. sendo de 8 u.m. para idêntica situação com uma cadeira).

Recorrendo ao método “Branch and Bound” obtém-se a solução óptima (melhor “solução de compromisso”):

$$x_1 = 30; x_2 = 5; d_2^- = 5$$

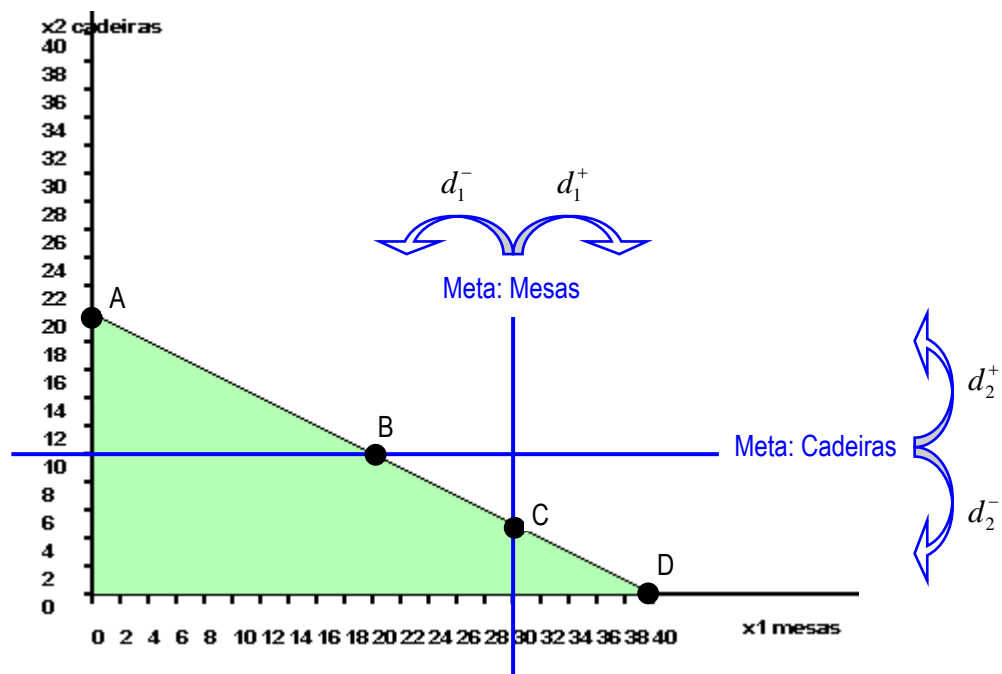
A 1ª meta é integralmente satisfeita (desvios por excesso e defeito são nulos).

A 2ª meta é cumprida por defeito ($d_2^- = 5$ cadeiras).

O plano óptimo de produção é pois de 30 mesas e 5 cadeiras.

O valor máximo do lucro da venda desta produção é $f(X^*) = 6x_1 + 8x_2 = 180 + 40 = 220$ u.m.

Veja-se na figura seguinte a interpretação geométrica:



Notar que o espaço de soluções é limitado exclusivamente pela restrição técnica $x_1 + 2x_2 \leq 40$. A solução óptima será a que minimiza a perda de lucro.

Analisemos a perda de lucro nos pontos A, B, C e D.

Ponto A ($x_1 = 0$; $x_2 = 20$)

Meta das Mesas:

$$x_1 - d_1^+ + d_1^- = 30 \Rightarrow 0 - 0 + 30 = 30 .$$

Temos $d_1^- = 30$ o que penaliza o lucro em $6(30) = 180$ u.m. (não há produção de mesas)

Meta das Cadeiras :

$$x_2 - d_2^+ + d_2^- = 10 \Rightarrow 20 - 10 + 0 = 10 .$$

Temos $d_2^- = 0$ não havendo penalização do lucro (produzem-se 10 cadeiras em excesso).

Valor dos desvios penalizantes (u.m.) = $f(D) = 6(30) = 180$ u.m.

Ponto B ($x_1 = 20$; $x_2 = 10$)

Meta das Mesas:

$$x_1 - d_1^+ + d_1^- = 30 \Rightarrow 20 - 0 + 10 = 30 .$$

Temos $d_1^- = 10$ o que penaliza o lucro em $6(10) = 60$ u.m. (10 mesas aquém da meta)

Meta das Cadeiras :

$$x_2 - d_2^+ + d_2^- = 10 \Rightarrow 10 - 0 + 0 = 10 .$$

Temos $d_2^- = 0$ não havendo penalização do lucro (produzem-se as 10 cadeiras desejadas).

Valor dos desvios penalizantes (u.m.) = $f(D) = 6(10) = 60$ u.m.

Ponto C ($x_1 = 30$; $x_2 = 5$)

Meta das Mesas:

$$x_1 - d_1^+ + d_1^- = 30 \Rightarrow 30 - 0 + 0 = 30 .$$

Temos $d_1^- = 0$ não havendo penalização do lucro (produzem-se as 30 mesas desejadas).

Meta das Cadeiras :

$$x_2 - d_2^+ + d_2^- = 10 \Rightarrow 5 - 0 + 5 = 10 .$$

Temos $d_2^- = 5$ o que penaliza o lucro em $f(D) = 8(5) = 40$ u.m. (5 cadeiras aquém da meta)

Valor dos desvios penalizantes (u.m.) = $f(D) = 8(5) = 40$ u.m.

Ponto D ($x_1 = 40$; $x_2 = 0$)

Meta das Mesas:

$$x_1 - d_1^+ + d_1^- = 30 \Rightarrow 40 - 10 + 0 = 30 .$$

Temos $d_1^- = 0$ não havendo penalização do lucro (produzem-se 10 mesas além do desejado).

Meta das Cadeiras :

$$x_2 - d_2^+ + d_2^- = 10 \Rightarrow 0 - 0 + 10 = 10 .$$

Temos $d_2^- = 10$ o que penaliza o lucro em $f(D) = 8(10) = 80$ u.m. (10 cadeiras aquém da meta)

Valor dos desvios penalizantes (u.m.) = $f(D) = 8(10) = 80$ u.m.

Solução ótima (melhor solução de compromisso)

Ponto C ($x_1 = 30$; $x_2 = 5$) onde se verifica o valor mínimo dos desvios penalizantes: $f(D) = 40$ u.m.

Produzir 30 mesas e 5 cadeiras com lucro total máximo de $f(X) = 6x_1 + 8x_2 = 220$ u.m.

Recorrendo ao software do autor é esta a solução obtida:

Identificação do Problema nº1 - Metas

☐ Max
 ☒ Min
 N.º de Var. Decisão 6

	x1	x2	d1+	d1-	d2+	d2-	Sinal	2º membro
Integralidade (clique)	Int	Int	Int	Int	Int	Int		
Lim. Superior	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10		
Lim. Inferior	0	0	0	0	0	0		
f(D)=	0	0	0	6	0	8		
Operários	1	2					<=	40
Meta: cadeiras		1			-1	1	=	10
Meta: mesas	1		-1	1			=	30

	Variável	Valor
ÓPTIMO	x1	30
	x2	5
	d2-	5
	f(D)=	40

2.

Descrição	Preferência do decisor	Equação da Meta	Desvios Penalizáveis
Mão-de-obra	$g_2(X) = 150$	$2x_1 + 6x_2 + 5x_3 - d_1^+ + d_1^- = 150$	Defeito (d_1^-) Excesso (d_1^+)

Estudo da Função objectivo a utilizar

Pretende-se $\text{Max } f(X) = 2g_1(X) - 5g_2(X) = 2(12x_1 + 18x_2 + 15x_3) - 5g_2(X) = 24x_1 + 36x_2 + 30x_3 - 5g_2(X)$

O desvio de $g_2(X)$ da meta “150” deve ser penalizado com coeficiente “-5” ou seja.

$$-5d_1^+ - 5d_1^-$$

A função a utilizar para optimização é pois $w(X) = 4x_1 + 6x_2 + 5x_3 - 5d_1^+ - 5d_1^-$ cujo gradiente permitirá calcular o ponto óptimo da produção (onde posteriormente será calculado o valor do lucro total).

Modelo para optimizar:

$$\begin{aligned}
 \text{Max } w(X) &= 24x_1 + 36x_2 + 30x_3 - 5d_1^+ - 5d_1^- \\
 \text{s.a.} \quad &2x_1 + 3x_2 + 2x_3 \leq 90 && \text{(restrição técnica para h/máquina)} \\
 &x_1 - 2x_2 = 0 && \text{(restrição técnica da relação entre A e B)} \\
 &2x_1 + 6x_2 + 5x_3 - d_1^+ + d_1^- = 150 && \text{(meta para pessoal)} \\
 &-2x_1 + x_3 \geq 0 && \text{(restrição técnica da relação entre A e C)}
 \end{aligned}$$

Utilizando o software do autor:

Identificação do Problema		nº2 - Metas					
<input checked="" type="radio"/> Max	Nº de Var. Decisão		5				
<input type="radio"/> Min							
	x1	x2	x3	d1+	d1-	Sinal	2º membro
w(X)=	24	36	30	-5	-5		
Horas/máquina	2	3	2			<=	90
A=dobro de B	1	-2				=	0
Meta	2	6	5	-1	1	=	150
C >= dobro de A	-2		1			>=	0

obtém-se a solução óptima:

Solução Óptima - Relatório	
Primal	Valor
x1	12
x2	6
x3	24
d1+	30
d1-	0

Leitura da solução óptima

Produzir 12 unidades de "A", 6 unidades de "B" e 24 unidades de "C".

São necessários 180 operários (desvio por excesso de 30 operários).

Valor máximo do lucro = $f(X) = 2g_1(X) - 5g_2(X) = 1224 - 900 = 324$ u.m.

Nota: Igual resultado seria obtido usando a função objectivo:

$$\text{Max } f(X) = 2g_1(X) - 5g_2(X) = 2(12x_1 + 18x_2 + 15x_3) - 5(2x_1 + 6x_2 + 5x_3) = 14x_1 + 6x_2 + 5x_3$$

Identificação do Problema							
nº2 - Metas							
<input checked="" type="radio"/> Max <input type="radio"/> Min							
Nº de Var. Decisão				5			
	x1	x2	x3	d1+	d1-	Sinal	2º membro
f(X)=	14	6	5	0	0		
Horas/máquina	2	3	2			<=	90
A=dobro de B	1	-2				=	0
Meta	2	6	5	-1	1	=	150
C >= dobro de A	-2		1			>=	0

Solução Óptima - Relatório	
Primal	Valor
x1	12
x2	6
x3	24
d1+	30
d1-	0
E4	0
F1	0
f(X)	324

Veja-se que o efeito da variável de desvio "d₁" é ajustar a mão-de-obra para consumir o máximo de horas disponíveis.

De facto se a mão-de-obra for declarada como restrição técnica, $2x_1 + 6x_2 + 5x_3 \leq 150$, na solução óptima constata-se que o completo aproveitamento dos 150 operários apenas necessita de 75 das 90 horas disponíveis (deixa-se ao leitor a tarefa de verificar esta informação).

3. Como x_1 e x_2 podem ter valor sem restrição de sinal são variáveis livres.

Se $x_1 \geq 0$ então $x_1 = x_1^+$ e no caso contrário $x_1 = x_1^-$ (x_1^+ e x_1^- não são mais do que os desvios por excesso e defeito do valor de x_1 e relação ao valor zero).

Actuando de igual modo com a variável x_2 tem-se:

$$f_1(x_1) = 3x_1^+ + x_1^- \text{ e } f_2(x_2) = 4x_2^+ + 3x_2^-$$

Para as restrições técnicas temos que considerar $x_1 = x_1^+ - x_1^-$ e $x_2 = x_2^+ - x_2^-$.

Modelo para otimizar:

$$\text{Min } f(X) = 3x_1^+ + x_1^- + 4x_2^+ + 3x_2^-$$

s.a.

$$(x_1^+ - x_1^-) + 2(x_2^+ - x_2^-) \leq 9$$

$$2(x_1^+ - x_1^-) + 3(x_2^+ - x_2^-) \geq 9$$

$$x_1^+, x_1^-, x_2^+, x_2^- \geq 0$$

Identificação do Problema						
nº3 - Metas						
<input type="radio"/> Max <input checked="" type="radio"/> Min						
Nº de Var. Decisão				4		
	x1+	x1-	x2+	x2-	Sinal	2º membro
f(X)=	3	1	4	3		
Restrição 1	1	-1	2	-2	<=	9
Restrição 2	2	-2	3	-3	>=	9

Solução Óptima - Relatório	
Primal	Valor
x1+	0
x1-	0
x2+	3
x2-	0
E2	0
F1	3
f(X)	12

$$x_1 = x_1^+ - x_1^- = 0 ; x_2 = x_2^+ - x_2^- = 3 - 0 = 3$$

A solução óptima é $x_1 = 0$; $x_2 = 3$; $\text{Min } f(X) = 12$ u.m.

4. Considerem-se x_1 e x_2 a produção de A e B respectivamente.

Descrição	Preferência do decisor	Equação da Meta	Desvios Penalizáveis
Capital	$x_1 + 2x_2 \leq 20$	$x_1 + 2x_2 - d_1^+ + d_1^- = 20$	Excesso (d_1^+)
Pessoal	$x_1 + x_2 = 15$	$x_1 + x_2 - d_2^+ + d_2^- = 15$	Excesso e Defeito (d_2^+, d_2^-)
Lucro	$2x_1 + x_2 \geq 40$	$2x_1 + x_2 - d_3^+ + d_3^- = 40$	Defeito (d_3^-)

Modelo para otimizar:

1ª prioridade : $\text{Min } f_1 = d_1^+$

2ª prioridade : $\text{Min } f_2 = d_2^+ + d_2^-$

3ª prioridade : $\text{Min } f_3 = d_3^-$

s.a.

$$x_1 + 2x_2 - d_1^+ + d_1^- = 20$$

$$x_1 + x_2 - d_2^+ + d_2^- = 15$$

$$2x_1 + x_2 - d_3^+ + d_3^- = 40$$

$$x_1, x_2, d_i^+, d_i^- \geq 0 \quad (i = 1, 2, 3)$$

Cálculo da solução ótima utilizando o "Simplex – Metas":

VB	x_1	x_2	d_1^+	d_1^-	d_2^+	d_2^-	d_3^+	d_3^-	VSM	Obs.
d_1^-	1	2	-1	1	0	0	0	0	20	
d_2^-	1	1	0	0	-1	1	0	0	15	
d_3^-	2	1	0	0	0	0	-1	1	40	
f_1			-1						0	
f_1	0	0	-1	0	0	0	0	0	0	Optimizar f_1 (1ª prioridade)

Em f_1 todos os coeficientes são não positivos (solução ótima). $\text{Min } f_1 = 0$.

A 1ª prioridade é integralmente satisfeita.

Na optimização das prioridades seguintes a variável d_1^+ deve manter-se nula garantindo assim o valor ótimo obtido $\text{Min } f_1 = d_1^+ = 0$.

Passemos à optimização da função f_2 :

VB	x_1	x_2	d_1^+	d_1^-	d_2^+	d_2^-	d_3^+	d_3^-	VSM	Obs.
d_1^-	1	2	-1	1	0	0	0	0	20	Optimizar f_2 (2ª prioridade). Anular em f_2 o coeficiente de d_2^- Entra para a base x_1 (ou x_2)
d_2^-	1	1	0	0	-1	1	0	0	15	
d_3^-	2	1	0	0	0	0	-1	1	40	
f_2					-1	-1				
f_2	1	1	0	0	-2	0	0	0	15	Ótimo para f_2
x_1	1	1	0	0	-1	1	0	0	15	
d_1^-	0	1	-1	1	1	-1	0	0	5	
d_3^-	0	-1	0	0	2	-2	-1	1	10	
f_2	0	0	0	0	-1	-1	0	0	0	

Em f_2 todos os coeficientes são não positivos (solução ótima). $\text{Min } f_2 = 0$.

A 2ª prioridade é integralmente satisfeita.

Na optimização das prioridades seguintes as variáveis d_1^+ , d_2^+ , d_2^- devem manter-se nulas garantindo assim o valor ótimo $f_1 = 0$ e $f_2 = 0$.

Passemos à optimização da função f_3 :

VB	x_1	x_2	d_1^+	d_1^-	d_2^+	d_2^-	d_3^+	d_3^-	VSM	Obs.
x_1	1	1	0	0	-1	1	0	0	15	Optimizar f_3 (3ª prioridade). Anular em f_3 o coeficiente de d_3^- Entra d_2^+
d_1^-	0	1	-1	1	1	-1	0	0	5	
d_3^-	0	-1	0	0	2	-2	-1	1	10	
f_3								-1		
f_3	0	-1	0	0	2	-2	-1	0	10	

Verifica-se que a entrada para a base da variável $d_2^+ = 5$ degrada o valor ótimo já obtido para $\text{Min } f_2 = 0$.

A mudança de base não pode portanto ser efectuada considerando-se atingido o valor ótimo $\text{Min } f_3 = 10$.

Leitura da solução "ótima"

Produção : 15 unidades de A.

Lucro máximo = $2x_1 + x_2 = 30$ u.m.

Metas do decisor

1ª prioridade (capital) : integralmente satisfeita ($\text{Min } f_1 = 0$).

2ª prioridade (pessoal) : integralmente satisfeita ($\text{Min } f_2 = 0$).

3ª prioridade (lucro) : satisfeita por defeito (menos 10 u.m.). $\text{Min } f_3 = 10$.

5.

- Escolha de nova VB

Uma VNB seleccionável para a base só é escolhida se e só se não conduzir à degradação do valor óptimo já atingido para funções de prioridade superior à da função em curso de optimização (sucedeu no exercício anterior ao iniciar-se a optimização de f_3).

- Empate na escolha de nova VB

Se duas ou mais VNB podem ser escolhidas para entrada na base a decisão é arbitrária.

- Empate na escolha da nova VNB (saída da base)

Se a menor “ratio” não negativa é obtida em mais do que uma das equações técnicas, sai da base a VB associada à equação da meta de maior prioridade. Se tal se verifica em metas de igual prioridade a escolha é arbitrária.

6. A solução do problema Primal é única se, não sendo degenerada, só as VB têm coeficiente nulo nas equações de todas as funções otimizadas.

Retomando, a título de exemplo, a questão nº 4 o quadro final é o seguinte:

VB	x_1	x_2	d_1^+	d_1^-	d_2^+	d_2^-	d_3^+	d_3^-	VSM
x_1	1	1	0	0	-1	1	0	0	15
d_1^-	0	1	-1	1	1	-1	0	0	5
d_3^-	0	-1	0	0	2	-2	-1	1	10
f_1	0	0	-1	0	0	0	0	0	0
f_2	0	0	0	0	-1	-1	0	0	0
f_3	0	-1	0	0	2	-2	-1	0	10

A solução ótima é única porque não é degenerada e só as VB têm coeficiente nulo em todas as equações das funções otimizadas.

7. Constitui-se um objectivo único $f = M_1 f_1 + M_2 f_2 + \dots + M_{k-1} f_{k-1} + 1f_k$ que reúne "k" objectivos.

Os coeficientes $M_1, M_2, \dots, M_{k-1}, 1$ são tais que M_1 é muito maior do que M_2 , M_2 é muito maior do que M_3 e assim sucessivamente.

No problema corrente pretende-se minimizar f_1, f_2, f_3 , por esta ordem, pelo que se organiza e minimiza a função:

$$\text{Min } f = M_1 f_1 + M_2 f_2 + f_3$$

Modelo para otimizar:

$$\text{Min } f(D) = M_1 d_1^+ + M_2 (d_2^+ + d_2^-) + d_3^- \quad \text{com } M_1 \gg M_2 \gg 1$$

s.a.

$$x_1 + 2x_2 - d_1^+ + d_1^- = 20$$

$$x_1 + x_2 - d_2^+ + d_2^- = 15$$

$$2x_1 + x_2 - d_3^+ + d_3^- = 40$$

$$x_1, x_2, d_i^+, d_i^- \geq 0 \quad (i = 1, 2, 3)$$

Cálculo da solução óptima:

VB	x_1	x_2	d_1^+	d_1^-	d_2^+	d_2^-	d_3^+	d_3^-	VSM	Obs.
d_1^-	1	2	-1	1	0	0	0	0	20	
d_2^-	1	1	0	0	-1	1	0	0	15	
d_3^-	2	1	0	0	0	0	-1	1	40	
f(D)			$-M_1$		$-M_2$	$-M_2$		-1	0	Anular coeficientes das VB d_2^- e d_3^-
f(D)	$M_2 + 2$	$M_2 + 1$	$-M_1$	0	$-2M_2$	0	-1	0	$15M_2 + 40$	Entra x_1 . Sai d_2^-
x_1	1	1	0	0	-1	0	0	0	15	
d_1^-	0	1	-1	1	1	1	0	0	5	
d_3^-	0	-1	0	0	2	0	-1	1	10	
f(D)	0	-1	$-M_1$	0	$-M_2 + 2$	$-M_2 - 2$	-1	0	10	Óptimo

Leitura da solução "óptima"

Produção : 15 unidades de A.

Lucro máximo = $2x_1 + x_2 = 30$ u.m.

Metas do decisor

1ª prioridade : $\text{Min } f_1 = d_1^+ = 0$

2ª prioridade : $\text{Min } f_2 = d_2^+ + d_2^- = 0$

3ª prioridade : $\text{Min } f_3 = d_3^- = 10$

8. Preferências do decisor e desvios indesejáveis:

Descrição	Preferência do decisor	Equação da Meta	Desvios Penalizáveis
Lucro	$6x_1 + 8x_2 \geq 90$ u.m.	$6x_1 + 8x_2 - d_1^+ + d_1^- = 90$	d_1^-
Receita da venda	$50x_1 + 25x_2 \geq 450$ u.m.	$50x_1 + 25x_2 - d_2^+ + d_2^- = 450$	d_2^-
Treino do pessoal	$x_1 + 3x_2 \geq 30$ h	$x_1 + 3x_2 - d_3^+ + d_3^- = 30$	d_3^-

Modelo para otimizar:

$$\text{Min } f = d_1^- + d_2^- + d_3^-$$

s.a.

$$30x_1 + 20x_2 \leq 300$$

$$5x_1 + 10x_2 \leq 110$$

$$6x_1 + 8x_2 - d_1^+ + d_1^- = 90$$

$$50x_1 + 25x_2 - d_2^+ + d_2^- = 450$$

$$x_1 + 3x_2 - d_3^+ + d_3^- = 30$$

$$x_1, x_2, d_i^+, d_i^- \geq 0 \text{ e Inteiro} \quad (i = 1, 2, 3)$$

Utilizando o software tem-se:

Identificação do Problema

C:\Exemplos_io\8_metas.int

☐ Max
☒ Min

Nº de Var. Decisão

8

	x1	x2	d1+	d1-	d2+	d2-	d3+	d3-	Sinal	2º membro
Integralidade (clique)	Int	Int	Int	Int	Int	Int	Int	Int		
Lim. Superior	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10		
Lim. Inferior	0	0	0	0	0	0	0	0		
f(D)=	0	0	0	1	0	1	0	1		
Madeira	30	20							<=	300
Horas trabalho	5	10							<=	110
Lucro venda	6	8	-1	1					=	90
Receita venda	50	25			-1	1			=	450
Horas treino	1	3					-1	1	=	30

	Variável	Valor
ÓPTIMO	x1	6
	x2	6
	d1-	6
	d3-	6
	f(D)=	12

$x_1 = 6$ (produzir 6 mesas) ; $x_2 = 6$ (produzir 6 cadeiras) ; $d_1^- = 6$ (só é possível obter $90 - 6 = 84$ u.m. de lucro) ; $d_2^- = 0$ (é possível obter a receita de 450 u.m.) ; $d_3^- = 6$ (só é possível efectuar $30 - 6 = 24$ horas de treino).

9.

Descrição	Preferência do decisor	Equação da Meta	Desvios Penalizáveis	Prioridade
Lucro	$6x_1 + 8x_2 \geq 90$	$6x_1 + 8x_2 - d_1^+ + d_1^- = 90$	d_1^-	1
Cad./mesas	$4x_1 - x_2 \leq 0$	$4x_1 - x_2 - d_2^+ + d_2^- = 0$	d_2^+	2
Capital	$44x_1 + 17x_2 \leq 325$	$44x_1 + 17x_2 - d_3^+ + d_3^- = 325$	d_3^+	3
Rec. venda	$50x_1 + 25x_2 \geq 450$	$50x_1 + 25x_2 - d_4^+ + d_4^- = 450$	d_4^-	4
Treino	$x_1 + 3x_2 \geq 30$	$x_1 + 3x_2 - d_5^+ + d_5^- = 30$	d_5^-	5

Modelo para otimizar:

$$\text{Min } f(D) = M_1 d_1^- + M_2 d_2^+ + M_3 d_3^+ + M_4 d_4^- + d_5^-$$

s.a.

$$30x_1 + 20x_2 \leq 300$$

$$5x_1 + 10x_2 \leq 110$$

$$6x_1 + 8x_2 - d_1^+ + d_1^- = 90$$

$$4x_1 - x_2 - d_2^+ + d_2^- = 0$$

$$44x_1 + 17x_2 - d_3^+ + d_3^- = 325$$

$$50x_1 + 25x_2 - d_4^+ + d_4^- = 450$$

$$x_1 + 3x_2 - d_5^+ + d_5^- = 30$$

$$x_j; d_i^+; d_i^- \geq 0 \text{ e Inteiro } (j = 1, 2; i = 1 \text{ a } 5)$$

Utilizando o software do autor tem-se (utilizando o método dos “Big M’s”):

Identificação do Problema

☐ Max
 ☒ Min
 N° de Var. Decisão

	x1	x2	d1+	d1-	d2+	d2-	d3+	d3-	d4+	d4-	d5+	d5-	Sinal	2º membro
Integralidade (clique)	Int	Int	Int	Int	Int	Int	Int	Int	Int	Int	Int	Int		
Lim. Superior	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10	1e+10		
Lim. Inferior	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0		
f(D)=	0	0	0	1000000	100000	0	10000	0	0	1000	0	1		
Madeira	30	20											<=	300
Horas trabalho	5	10											<=	110
Lucro venda	6	8	-1	1									=	90
Cadeiras/Mesas	4	-1			-1	1							=	0
Capital	44	17					-1	1					=	325
Receita venda	50	25							-1	1			=	450
Horas treino	1	3									-1	1	=	30

Notar o valor, em f(D), dos coeficientes dos desvios penalizáveis:

$$M_1 = 1\,000\,000; M_2 = 100\,000; M_3 = 10\,000; M_4 = 1\,000; M_5 = 1$$

	Variável	Valor
ÓPTIMO	x1	2
	x2	10
	d1+	2
	d2-	2
	d3-	67
	d4-	100
	d5+	2
	f(D)=	100000

Produção ótima: 2 mesas ($x_1 = 2$) e 10 cadeiras ($x_2 = 10$)

$d_1^+ = 2$ (Lucro = 92 u.m. ; excesso de 2 u.m. no lucro ; $\text{Min } f_1 = d_1^- = 0$; 1ª meta satisfeita)

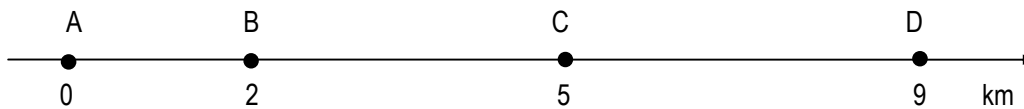
$d_2^- = 2$ (excesso de 2 cadeiras; $\text{Min } f_2 = d_2^+ = 0$; 2ª meta satisfeita)

$d_3^- = 67$ (defeito de 67 u.m. no capital a investir; $\text{Min } f_3 = d_3^+ = 0$; 3ª meta satisfeita)

$d_4^- = 100$ (defeito de 100 u.m. na receita da venda; $\text{Min } f_4 = d_4^- = 100$; 4ª meta não satisfeita)

$d_5^+ = 2$ (excesso de 2 horas de treino ; $\text{Min } f_5 = d_5^- = 0$; 5ª meta satisfeita)

10. Considere-se um eixo de abcissas (km) e as localidades na sua posição relativa:



Admitindo a estação localizada na abcissa de valor "x", a distância a que ficará cada uma das localidades é um desvio relativamente ao desejável (estação na própria localidade):

Descrição	Preferência do decisor	Equação da Meta	Desvios Penalizáveis
A	$x = 0$	$x - d_A^+ + d_A^- = 0$	Ambos
B	$x = 2$	$x - d_B^+ + d_B^- = 2$	Ambos
C	$x = 5$	$x - d_C^+ + d_C^- = 5$	Ambos
D	$x = 9$	$x - d_D^+ + d_D^- = 9$	Ambos

Objectivo: $\text{Min } f(D) = 100(d_A^+ + d_A^-) + 400(d_B^+ + d_B^-) + 200(d_C^+ + d_C^-) + 300(d_D^+ + d_D^-)$

Todas as variáveis do modelo são não negativas.

Identificação do Problema

nº 10 - Metas

☐ Max

Nº de Var. Decisão

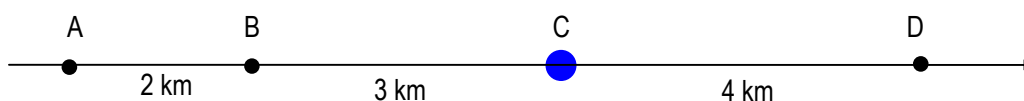
☒ Min

9

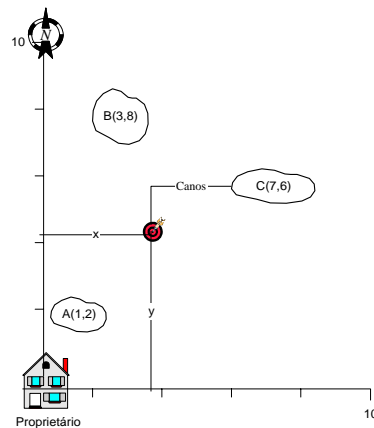
	x	da+	da-	db+	db-	dc+	dc-	dd+	dd-	Sinal	2º membro
f (X)=	0	100	100	400	400	200	200	300	300		
Restrição 1	1	-1	1							=	0
Restrição 2	1			-1	1					=	2
Restrição 3	1					-1	1			=	5
Restrição 4	1							-1	1	=	9

Solução Óptima - Relatório	
Valores associados à 1ª so	
Primal	Valor
x	5
da+	5
da-	0
db+	3
db-	0
dc+	0
dc-	0
dd+	0
dd-	4
f(x)	2900

Localização óptima (não única) : C



11. Considerem-se “x” e “y” as coordenadas óptimas do furo.



Relativamente a qualquer das áreas, vista separadamente, o ideal seria que o furo nela tivesse lugar. Como tal não é possível é necessário estabelecer um compromisso.

Considerando $x_A^+, x_A^-, x_B^+, x_B^-, x_C^+, x_C^-$ os desvios por excesso e defeito na direcção Este-Oeste (será o comprimento do tubo de ligação necessário e $y_A^+, y_A^-, y_B^+, y_B^-, y_C^+, y_C^-$ idênticos desvios na direcção Norte-Sul, o modelo de PL para otimizar a localização do furo e consequentemente minimizar o custo das ligações é o seguinte:

$$\text{Min } f(x, y) = 100(x_A^+ + x_A^- + y_A^+ + y_A^-) + 300(x_B^+ + x_B^- + y_B^+ + y_B^-) + 200(x_C^+ + x_C^- + y_C^+ + y_C^-)$$

s.a.

$$x - x_A^+ + x_A^- = 1$$

$$y - y_A^+ + y_A^- = 2$$

$$x - x_B^+ + x_B^- = 3$$

$$y - y_B^+ + y_B^- = 8$$

$$x - x_C^+ + x_C^- = 7$$

$$y - y_C^+ + y_C^- = 6$$

$$x, y, x_A^+, x_A^-, y_A^+, y_A^-, x_B^+, x_B^-, y_B^+, y_B^-, x_C^+, x_C^-, y_C^+, y_C^- \geq 0$$

Utilizando o software do autor:

Identificação do Problema

Nº 11 - Metas

☐ Max

Nº de Var. Decisão

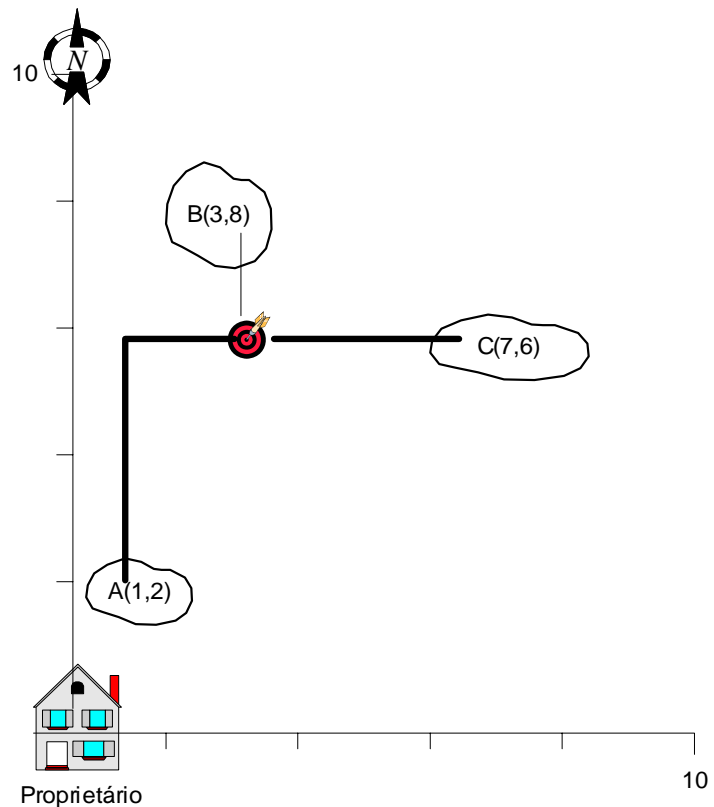
14

☒ Min

	x	y	xa+	xa-	xb+	xb-	xc+	xc-	ya+	ya-	yb+	yb-	yc+	yc-	Sinal	2º membro
f(X)=	0	0	100	100	300	300	200	200	100	100	300	300	200	200		
A	1		-1	1											=	1
B	1				-1	1									=	3
C	1						-1	1							=	7
A		1							-1	1					=	2
B		1									-1	1			=	8
C		1											-1	1	=	6

Solução Óptima - Relatório	
Valores associados à 1ª so	
Primal	Valor
x	3
y	6
xa+	2
xa-	0
xb+	0
xb-	0
xc+	0
xc-	4
ya+	4
ya-	0
yb+	0
yb-	2
yc+	0
yc-	0
f(x)	2000

As ligações óptimas são as seguintes:



Relativamente à casa, o furo deve ser aberto 3 km para Este e 6 km para Norte.

São necessários 6 km de tubo para a ligação a "A" (600 u.m.), 2 km para B (600 u.m.) e 4 km para C (800 u.m.) com custo total mínimo de 2000 u.m.

12. Variáveis de decisão: x_A, x_B, x_C, x_D (número de páginas a dactilografar em A, B, C, D respectivamente)

Restrições técnicas:

Capacidade das empresas (total de páginas)

- $x_A \leq 320$ (50 horas a 6.4 páginas/h)
- $x_B \leq 208$ (40 horas a 5.2pgs./h)
- $x_C \leq 375$ (50 horas a 7.5 páginas/h)
- $x_D \leq 308$ (35 horas a 8.8 páginas/h)

Estudo das Metas a fixar:

Descrição	Preferência do decisor	Equação da Meta	Desvios Penalizáveis
Pgs./semana	≥ 1000	$x_A + x_B + x_C + x_D - d_1^+ + d_1^- = 1000$	Defeito
Erros	≤ 12	$0.015x_A + 0.018x_B + 0.008x_C + 0.012x_D - d_2^+ + d_2^- = 12$	Excesso
Custo (u.m.)	≤ 3000	$3.5x_A + 2.4x_B + 3.75x_C + 3.9x_D - d_3^+ + d_3^- = 3000$	Excesso

Prioridade	Objectivo
1	$\text{Min } f_1 = d_1^-$
2	$\text{Min } f_2 = d_2^+$
3	$\text{Min } f_3 = d_3^+$

Modelo para otimizar:

$$\text{Min } f(D) = M_1 d_1^- + M_2 d_2^+ + d_3^+$$

s.a.

- $x_A \leq 320$ (50 horas a 6.4 páginas/h)
- $x_B \leq 208$ (40 horas a 5.2pgs./h)
- $x_C \leq 375$ (50 horas a 7.5 páginas/h)
- $x_D \leq 308$ (35 horas a 8.8 páginas/h)
- $x_A + x_B + x_C + x_D - d_1^+ + d_1^- = 1000$ (páginas para 1 semana; 1ª prioridade)
- $0.015x_A + 0.018x_B + 0.008x_C + 0.012x_D - d_2^+ + d_2^- = 12$ (erros; 2ª prioridade)
- $3.5x_A + 2.4x_B + 3.75x_C + 3.9x_D - d_3^+ + d_3^- = 3000$ (custo; 3ª prioridade)
- $x_A, x_B, x_C, x_D, d_i^+, d_i^- \geq 0$ e Inteiro ($i = 1, 2, 3$)

Utilizando o Solver do Excel obtém-se:

Solução	148.0	174.0	372.0	306.0	0.0	0.0	0.0	0.0	524.0	0.0		
Variáveis	xA	xB	xC	xD	d1+	d1-	d2+	d2-	d3+	d3-	1º membro	VSM
	1.0	1.0	1.0	1.0	-1.0	1.0	0.0	0.0	0.0	0.0	1000.0	1000.0
	0.015	0.018	0.008	0.012			-1.0	1.0			12.0	12.0
	3.5	2.4	3.8	3.9					-1.0	1.0	3000.0	3000.0
f(D) =							1000000.0	100000.0	1.0		Objectivo	
											524.0	
Custo total	3524.0											

A solução "óptima" é a seguinte:

- Empresa A : executar 148 páginas
- Empresa B : executar 174 páginas
- Empresa C : executar 372 páginas
- Empresa D : executar 306 páginas

As metas de 1ª e 2ª prioridades são integralmente satisfeitas (1000 páginas ; 12 erros).

A meta de 3ª prioridade é excedida em $d_3^+ = 524$ u.m. ou seja o custo total é de 3524 u.m.