

Simplexová metoda na řešení lineárního programování

Tomáš Werner

16. prosince 2017

Máme mnohostěn

$$X = \{ \mathbf{x} \in \mathbb{R}^n \mid \mathbf{Ax} = \mathbf{b}, \mathbf{x} \geq \mathbf{0} \}$$

kde $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times n}$ a $\text{rank } \mathbf{A} = m$.

Máme mnohostěn

$$X = \{ \mathbf{x} \in \mathbb{R}^n \mid \mathbf{Ax} = \mathbf{b}, \mathbf{x} \geq \mathbf{0} \}$$

kde $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times n}$ a $\text{rank } \mathbf{A} = m$.

- ▶ $J \subseteq \{1, 2, \dots, n\}$ je **báze**, pokud $|J| = m$ a sloupce matice \mathbf{A} s indexy J jsou lineárně nezávislé. Tedy sloupce J tvoří regulární matici $m \times m$.
- ▶ Vektor \mathbf{x} je **bázové řešení** příslušné bázi J , pokud

$$\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$$

$$x_j = 0 \quad \forall j \notin J$$

- ▶ Bázové řešení \mathbf{x} je **přípustné**, pokud $\mathbf{x} \geq \mathbf{0}$.
- ▶ Bázové řešení \mathbf{x} je **degenerované**, pokud má méně než m nenulových složek.

Máme mnohostěn

$$X = \{ \mathbf{x} \in \mathbb{R}^n \mid \mathbf{Ax} = \mathbf{b}, \mathbf{x} \geq \mathbf{0} \}$$

kde $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times n}$ a $\text{rank } \mathbf{A} = m$.

- ▶ $J \subseteq \{1, 2, \dots, n\}$ je **báze**, pokud $|J| = m$ a sloupce matice \mathbf{A} s indexy J jsou lineárně nezávislé. Tedy sloupce J tvoří regulární matici $m \times m$.
- ▶ Vektor \mathbf{x} je **bázové řešení** příslušné bázi J , pokud

$$\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$$

$$x_j = 0 \quad \forall j \notin J$$

- ▶ Bázové řešení \mathbf{x} je **přípustné**, pokud $\mathbf{x} \geq \mathbf{0}$.
- ▶ Bázové řešení \mathbf{x} je **degenerované**, pokud má méně než m nenulových složek.

Platí (bez důkazu):

- ▶ Přípustná bázová řešení jsou právě vrcholy mnohostěnu X .
- ▶ Lineární funkce nabývá na mnohostěnu minima aspoň v jednom vrcholu.

$$[\mathbf{A} \quad \mathbf{b}] = \begin{array}{ccccccc} -1 & 1 & 3 & 1 & 0 & 2 & 1 \\ 1 & 0 & 4 & 0 & 1 & 4 & 4 \\ -1 & 0 & 4 & 1 & 1 & 4 & 2 \end{array}$$

$$[\mathbf{A} \quad \mathbf{b}] = \begin{array}{cccccccc} -1 & 1 & 3 & 1 & 0 & 2 & 1 \\ 1 & 0 & 4 & 0 & 1 & 4 & 4 \\ -1 & 0 & 4 & 1 & 1 & 4 & 2 \end{array}$$

- ▶ $\{2, 3, 5\}$ není báze (sloupce jsou lineárně závislé)

$$[\mathbf{A} \quad \mathbf{b}] = \begin{array}{ccccccc} -1 & 1 & 3 & 1 & 0 & 2 & 1 \\ 1 & 0 & 4 & 0 & 1 & 4 & 4 \\ -1 & 0 & 4 & 1 & 1 & 4 & 2 \end{array}$$

$$\mathbf{x} = \begin{array}{cccccc} 3 & 0 & 0 & 4 & 1 & 0 \end{array}$$

- ▶ $\{2, 3, 5\}$ není báze (sloupce jsou lineárně závislé)
- ▶ $\{1, 4, 5\}$ je báze. Bázové řešení $\mathbf{x} = (x_1, \dots, x_6)$ je jednoznačné řešení soustavy

$$\begin{bmatrix} -1 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \\ -1 & 1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_4 \\ x_5 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 4 \\ 2 \end{bmatrix}$$

$$x_2 = x_3 = x_6 = 0$$

Je přípustné a není degenerované.

$$[\mathbf{A} \quad \mathbf{b}] = \begin{array}{ccccccc} -1 & 1 & 3 & 1 & 0 & 2 & 1 \\ 1 & 0 & 4 & 0 & 1 & 4 & 4 \\ -1 & 0 & 4 & 1 & 1 & 4 & 2 \end{array}$$

$$\mathbf{x} = \begin{array}{cccccc} 4 & -1 & 0 & 6 & 0 & 0 \end{array}$$

- ▶ $\{2, 3, 5\}$ není báze (sloupce jsou lineárně závislé)
- ▶ $\{1, 4, 5\}$ je báze. Bázové řešení $\mathbf{x} = (x_1, \dots, x_6)$ je jednoznačné řešení soustavy

$$\begin{bmatrix} -1 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \\ -1 & 1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_4 \\ x_5 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 4 \\ 2 \end{bmatrix}$$

$$x_2 = x_3 = x_6 = 0$$

Je přípustné a není degenerované.

- ▶ $\{1, 2, 4\}$ je báze. Bázové řešení je nepřípustné.

$$[\mathbf{A} \quad \mathbf{b}] = \begin{array}{ccccccc} -1 & 1 & 3 & 1 & 0 & 2 & 1 \\ 1 & 0 & 4 & 0 & 1 & 4 & 4 \\ -1 & 0 & 4 & 1 & 1 & 4 & 2 \end{array}$$

$$\mathbf{x} = \begin{array}{cccccc} 0 & 0 & 1 & -2 & 0 & 0 \end{array}$$

- ▶ $\{2, 3, 5\}$ není báze (sloupce jsou lineárně závislé)
- ▶ $\{1, 4, 5\}$ je báze. Bázové řešení $\mathbf{x} = (x_1, \dots, x_6)$ je jednoznačné řešení soustavy

$$\begin{bmatrix} -1 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \\ -1 & 1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_4 \\ x_5 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 4 \\ 2 \end{bmatrix}$$

$$x_2 = x_3 = x_6 = 0$$

Je přípustné a není degenerované.

- ▶ $\{1, 2, 4\}$ je báze. Bázové řešení je nepřípustné.
- ▶ $\{3, 4, 5\}$ je báze. Bázové řešení je nepřípustné a degenerované.

$$[\mathbf{A} \quad \mathbf{b}] = \begin{array}{ccccccc} -1 & 1 & 3 & 1 & 0 & 2 & 1 \\ 1 & 0 & 4 & 0 & 1 & 4 & 4 \\ -1 & 0 & 4 & 1 & 1 & 4 & 2 \end{array}$$

$$\mathbf{x} = \begin{array}{cccccc} 0 & 0 & 1 & -2 & 0 & 0 \end{array}$$

- ▶ $\{2, 3, 5\}$ není báze (sloupce jsou lineárně závislé)
- ▶ $\{1, 4, 5\}$ je báze. Bázové řešení $\mathbf{x} = (x_1, \dots, x_6)$ je jednoznačné řešení soustavy

$$\begin{bmatrix} -1 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 \\ -1 & 1 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_4 \\ x_5 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 4 \\ 2 \end{bmatrix}$$

$$x_2 = x_3 = x_6 = 0$$

Je přípustné a není degenerované.

- ▶ $\{1, 2, 4\}$ je báze. Bázové řešení je nepřípustné.
- ▶ $\{3, 4, 5\}$ je báze. Bázové řešení je nepřípustné a degenerované.
- ▶ Stejně bázové řešení odpovídá bázi $\{3, 4, 6\}$.

Degenerované bázové řešení odpovídá více než jedné bázi!

Simplexová metoda používá jen **standardní** báze. Výhody:

- ▶ Ihned vidíme bázové řešení \mathbf{x} : jeho nenulové složky jsou složky \mathbf{b} .
- ▶ \mathbf{x} je přípustné $\Leftrightarrow \mathbf{b} \geq \mathbf{0}$

$$\begin{array}{r} [\mathbf{A} \quad \mathbf{b}] = \\ \mathbf{x} = \end{array} \begin{array}{cccccc} 0 & 2 & 6 & 1 & 0 & 4 & 4 \\ 1 & 1 & 3 & 0 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & -1 & 1 & 0 & 1 & 2 & 1 \\ 3 & 0 & 0 & 4 & 1 & 0 & \end{array}$$

Bázové řešení příslušné (standardní) bázi $\{1, 4, 5\}$ je řešením soustavy

$$\begin{bmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_4 \\ x_5 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 4 \\ 3 \\ 1 \end{bmatrix}$$
$$x_2 = x_3 = x_6 = 0$$

Ekvivalentní řádkové úpravy (nemění množinu řešení soustavy $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$):

- ▶ Řádek matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ vynásobíme nenulovým číslem.
- ▶ K řádku matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ přičteme lin. kombinaci ostatních řádků.

Chceme bázový sloupec $j' \in J$ nahradit nebázovým sloupcem $j \notin J$:

- ▶ **Pivot** je prvek (i, j) , kde i je řádek pro který $a_{ij} = 1$.

$$\begin{array}{ccccccc} 0 & 2 & 6 & 1 & 0 & 4 & 4 \\ 1 & \mathbf{1} & 3 & 0 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & -1 & 1 & 0 & 1 & 2 & 1 \\ \downarrow & \uparrow & & & & & \end{array}$$

Ekvivalentní řádkové úpravy (nemění množinu řešení soustavy $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$):

- ▶ Řádek matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ vynásobíme nenulovým číslem.
- ▶ K řádku matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ přičteme lin. kombinaci ostatních řádků.

Chceme bázový sloupec $j' \in J$ nahradit nebázovým sloupcem $j \notin J$:

- ▶ **Pivot** je prvek (i, j) , kde i je řádek pro který $a_{ij} = 1$.

$$\begin{array}{ccccccc} 0 & 2 & 6 & 1 & 0 & 4 & 4 \\ 1 & \mathbf{1} & 3 & 0 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & -1 & 1 & 0 & 1 & 2 & 1 \\ \downarrow & \uparrow & & & & & \end{array}$$

Nutno pivot nastavit na 1 a prvky nad i pod pivotem na 0:

Ekvivalentní řádkové úpravy (nemění množinu řešení soustavy $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$):

- ▶ Řádek matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ vynásobíme nenulovým číslem.
- ▶ K řádku matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ přičteme lin. kombinaci ostatních řádků.

Chceme bázový sloupec $j' \in J$ nahradit nebázovým sloupcem $j \notin J$:

- ▶ **Pivot** je prvek (i, j) , kde i je řádek pro který $a_{ij} = 1$.

$$\begin{array}{ccccccc} 0 & 2 & 6 & 1 & 0 & 4 & 4 \\ 1 & \mathbf{1} & 3 & 0 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & -1 & 1 & 0 & 1 & 2 & 1 \\ \downarrow & \uparrow & & & & & \end{array}$$

Nutno pivot nastavit na 1 a prvky nad i pod pivotem na 0:

- 1 Vydělíme řádek i pivotem a_{ij} .

Ekvivalentní řádkové úpravy (nemění množinu řešení soustavy $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$):

- ▶ Řádek matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ vynásobíme nenulovým číslem.
- ▶ K řádku matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ přičteme lin. kombinaci ostatních řádků.

Chceme bázový sloupec $j' \in J$ nahradit nebázovým sloupcem $j \notin J$:

- ▶ **Pivot** je prvek (i, j) , kde i je řádek pro který $a_{ij} = 1$.

$$\begin{array}{ccccccc} -2 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & -2 \\ 1 & 1 & 3 & 0 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & -1 & 1 & 0 & 1 & 2 & 1 \\ \downarrow & \uparrow & & & & & \end{array}$$

Nutno pivot nastavit na 1 a prvky nad i pod pivotem na 0:

- 1 Vydělíme řádek i pivotem a_{ij} .
- 2 Pro každé $i' \neq i$ odečteme $a_{i'j}$ -násobek pivotového řádku i od řádku i' .

Ekvivalentní řádkové úpravy (nemění množinu řešení soustavy $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$):

- ▶ Řádek matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ vynásobíme nenulovým číslem.
- ▶ K řádku matice $[\mathbf{A} \ \mathbf{b}]$ přičteme lin. kombinaci ostatních řádků.

Chceme bázový sloupec $j' \in J$ nahradit nebázovým sloupcem $j \notin J$:

- ▶ **Pivot** je prvek (i, j) , kde i je řádek pro který $a_{ij} = 1$.

$$\begin{array}{ccccccc} -2 & 0 & 0 & 1 & 0 & 0 & -2 \\ 1 & 1 & 3 & 0 & 0 & 2 & 3 \\ 1 & 0 & 4 & 0 & 1 & 4 & 4 \\ \downarrow & \uparrow & & & & & \end{array}$$

Nutno pivot nastavit na 1 a prvky nad i pod pivotem na 0:

- 1 Vydělíme řádek i pivotem a_{ij} .
- 2 Pro každé $i' \neq i$ odečteme $a_{i'j}$ -násobek pivotového řádku i od řádku i' .

Kdy bude nové bázové řešení přípustné?

Nechť $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$. Jak poznáme, zda po ekv. úpravě kolem pivotu (i, j) zůstane $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$?

Jak se změní \mathbf{b} po ekv. úpravě kolem pivotu (i, j) ?

- ▶ b_i se změní na b_i/a_{ij} .
- ▶ Pro každé $i' \neq i$ se $b_{i'}$ změní na $b_{i'} - a_{i'j}b_i/a_{ij}$.

Tato čísla musejí zůstat nezáporná, což nastane právě když (rozmyslete!)

- ▶ $a_{ij} > 0$
- ▶ Pro každé $i' \neq i$ platí: $(a_{i'j} \leq 0)$ nebo $(b_i/a_{ij} \leq b_{i'}/a_{i'j})$.

Kdy bude nové bázové řešení přípustné?

Nechť $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$. Jak poznáme, zda po ekv. úpravě kolem pivotu (i, j) zůstane $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$?

Jak se změní \mathbf{b} po ekv. úpravě kolem pivotu (i, j) ?

- ▶ b_i se změní na b_i/a_{ij} .
- ▶ Pro každé $i' \neq i$ se $b_{i'}$ změní na $b_{i'} - a_{i'j}b_i/a_{ij}$.

Tato čísla musejí zůstat nezáporná, což nastane právě když (rozmyslete!)

- ▶ $a_{ij} > 0$
- ▶ Pro každé $i' \neq i$ platí: $(a_{i'j} \leq 0)$ nebo $(b_i/a_{ij} \leq b_{i'}/a_{i'j})$.

0	2	6	1	0	4	4
1	1	3	0	0	2	3
0	-1	1	0	1	2	1

- ▶ Po úpravě kolem pivotu $(3, 2)$ **nebude** $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$, neboť $-1 \not\geq 0$.

Kdy bude nové bázové řešení přípustné?

Nechť $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$. Jak poznáme, zda po ekv. úpravě kolem pivotu (i, j) zůstane $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$?

Jak se změní \mathbf{b} po ekv. úpravě kolem pivotu (i, j) ?

- ▶ b_i se změní na b_i/a_{ij} .
- ▶ Pro každé $i' \neq i$ se $b_{i'}$ změní na $b_{i'} - a_{i'j}b_i/a_{ij}$.

Tato čísla musejí zůstat nezáporná, což nastane právě když (rozmyslete!)

- ▶ $a_{ij} > 0$
- ▶ Pro každé $i' \neq i$ platí: $(a_{i'j} \leq 0)$ nebo $(b_i/a_{ij} \leq b_{i'}/a_{i'j})$.

0	2	6	1	0	4	4
1	1	3	0	0	2	3
0	-1	1	0	1	2	1

- ▶ Po úpravě kolem pivotu $(3, 2)$ **nebude** $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$, neboť $-1 \not\geq 0$.
- ▶ Po úpravě kolem pivotu $(3, 2)$ **nebude** $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$, neboť $\frac{3}{1} \not\geq \frac{4}{2}$

Kdy bude nové bázevé řešení přípustné?

Nechť $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$. Jak poznáme, zda po ekv. úpravě kolem pívotu (i, j) zůstane $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$?

Jak se změní \mathbf{b} po ekv. úpravě kolem pívotu (i, j) ?

- ▶ b_i se změní na b_i/a_{ij} .
- ▶ Pro každé $i' \neq i$ se $b_{i'}$ změní na $b_{i'} - a_{i'j}b_i/a_{ij}$.

Tato čísla musejí zůstat nezáporná, což nastane právě když (rozmyslete!)

- ▶ $a_{ij} > 0$
- ▶ Pro každé $i' \neq i$ platí: $(a_{i'j} \leq 0)$ nebo $(b_i/a_{ij} \leq b_{i'}/a_{i'j})$.

0	2	6	1	0	4	4
1	1	3	0	0	2	3
0	-1	1	0	1	2	1

- ▶ Po úpravě kolem pívotu $(3, 2)$ **nebude** $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$, neboť $-1 \not\geq 0$.
- ▶ Po úpravě kolem pívotu $(3, 2)$ **nebude** $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$, neboť $\frac{3}{1} \not\geq \frac{4}{2}$
- ▶ Po úpravě kolem pívotu $(3, 6)$ **bude** $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$, neboť $2 > 0$, $\frac{1}{2} \leq \frac{3}{2}$, $\frac{1}{2} \leq \frac{4}{4}$.

Když jsou všechny prvky v nebázovém sloupci $j \notin J$ nekladné:

- ▶ Sloupec j se nemůže stát bázovým (nelze v něm vybrat pivot).
- ▶ Existuje směr \mathbf{v} tak, že $\mathbf{x} + \alpha\mathbf{v} \in X$ pro každé $\alpha \geq 0$
(\Rightarrow mnohostěn obsahuje polopřímku, tedy je **neomezený**).

$$[\mathbf{A} \quad \mathbf{b}] = \begin{array}{ccccccc} & 0 & -2 & 6 & 1 & 0 & 4 & 4 \\ & 1 & -1 & 3 & 0 & 0 & 2 & 3 \\ & 0 & -1 & 1 & 0 & 1 & 2 & 1 \end{array}$$

$$\mathbf{x} = \begin{array}{cccccc} 3 & 0 & 0 & 4 & 1 & 0 \end{array}$$

$$\mathbf{v} = \begin{array}{cccccc} 1 & 1 & 0 & 2 & 1 & 0 \end{array}$$

Vektor \mathbf{v} je jednoznačným řešením soustavy

$$\mathbf{A}\mathbf{v} = \mathbf{0}$$

$$v_j = 1$$

$$v_{j'} = 0 \quad \forall j' \notin J, j' \neq j$$

Řešení: bázové složky \mathbf{v} jsou rovny minus prvky sloupce j .

Lineární program

$$\min\{\mathbf{c}^T \mathbf{x} - d \mid \mathbf{Ax} = \mathbf{b}, \mathbf{x} \geq \mathbf{0}\}$$

reprezentujeme **simplexovou tabulkou**

$$\begin{bmatrix} \mathbf{c}^T & d \\ \mathbf{A} & \mathbf{b} \end{bmatrix}$$

Přičtíme k prvnímu (účelovému) řádku tabulky lineární kombinaci ostatních řádků:

$$[\mathbf{c}'^T \quad d'] = [\mathbf{c}^T \quad d] + \mathbf{y}^T [\mathbf{A} \quad \mathbf{b}] = [\mathbf{c}^T + \mathbf{y}^T \mathbf{A} \quad d + \mathbf{y}^T \mathbf{b}]$$

Nová účelová funkce:

$$\begin{aligned} \mathbf{c}'^T \mathbf{x} - d' &= (\mathbf{c}^T + \mathbf{y}^T \mathbf{A})\mathbf{x} - (d + \mathbf{y}^T \mathbf{b}) \\ &= \mathbf{c}^T \mathbf{x} - d + \mathbf{y}^T (\mathbf{Ax} - \mathbf{b}) \\ &= \mathbf{c}^T \mathbf{x} - d \quad \text{když } \mathbf{Ax} = \mathbf{b} \end{aligned}$$

Hodnota účelové funkce zůstane stejná pro všechna řešení soustavy $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$
 \Rightarrow úloha se nezmění.

Takto můžeme vynulovat bázové složky vektoru \mathbf{c} , tj. $c_j = 0$ pro $j \in J$
(vždy přičti k účelovému řádku násobek řádku, který má ve sloupci j jedničku).

$$\begin{array}{rcl} [\mathbf{c}^T & d] = & 1 \quad -2 \quad -3 \quad -1 \quad 2 \quad 1 \quad 4 \\ & & 0 \quad 2 \quad 6 \quad 1 \quad 0 \quad 4 \quad 4 \\ [\mathbf{A} & \mathbf{b}] = & 1 \quad 1 \quad 3 \quad 0 \quad 0 \quad 2 \quad 3 \\ & & 0 \quad -1 \quad 1 \quad 0 \quad 1 \quad 2 \quad 1 \\ & \mathbf{x} = & 3 \quad 0 \quad 0 \quad 4 \quad 1 \quad 0 \end{array}$$

Takto můžeme vynulovat bázové složky vektoru \mathbf{c} , tj. $c_j = 0$ pro $j \in J$
 (vždy přičti k účelovému řádku násobek řádku, který má ve sloupci j jedničku).

$$\begin{array}{rcl}
 [\mathbf{c}^T & d] = & 0 \quad -3 \quad -6 \quad -1 \quad 2 \quad -1 \quad 1 \\
 & & 0 \quad 2 \quad 6 \quad 1 \quad 0 \quad 4 \quad 4 \\
 [\mathbf{A} & \mathbf{b}] = & 1 \quad 1 \quad 3 \quad 0 \quad 0 \quad 2 \quad 3 \\
 & & 0 \quad -1 \quad 1 \quad 0 \quad 1 \quad 2 \quad 1 \\
 & & \\
 \mathbf{x} = & & 3 \quad 0 \quad 0 \quad 4 \quad 1 \quad 0
 \end{array}$$

Takto můžeme vynulovat bázové složky vektoru \mathbf{c} , tj. $c_j = 0$ pro $j \in J$
(vždy přičti k účelovému řádku násobek řádku, který má ve sloupci j jedničku).

$$\begin{array}{rcl} [\mathbf{c}^T & d] = & 0 \quad -1 \quad 0 \quad 0 \quad 2 \quad 3 \quad 5 \\ & & 0 \quad 2 \quad 6 \quad 1 \quad 0 \quad 4 \quad 4 \\ [\mathbf{A} & \mathbf{b}] = & 1 \quad 1 \quad 3 \quad 0 \quad 0 \quad 2 \quad 3 \\ & & 0 \quad -1 \quad 1 \quad 0 \quad 1 \quad 2 \quad 1 \\ & \mathbf{x} = & 3 \quad 0 \quad 0 \quad 4 \quad 1 \quad 0 \end{array}$$

Takto můžeme vynulovat bázové složky vektoru \mathbf{c} , tj. $c_j = 0$ pro $j \in J$
 (vždy přičti k účelovému řádku násobek řádku, který má ve sloupci j jedničku).

$$\begin{array}{rcl}
 [\mathbf{c}^T & d] = & 0 \quad 1 \quad -2 \quad 0 \quad 0 \quad -1 \quad 3 \\
 & & 0 \quad 2 \quad 6 \quad 1 \quad 0 \quad 4 \quad 4 \\
 [\mathbf{A} & \mathbf{b}] = & 1 \quad 1 \quad 3 \quad 0 \quad 0 \quad 2 \quad 3 \\
 & & 0 \quad -1 \quad 1 \quad 0 \quad 1 \quad 2 \quad 1 \\
 & & \\
 \mathbf{x} = & & 3 \quad 0 \quad 0 \quad 4 \quad 1 \quad 0
 \end{array}$$

Takto můžeme vynulovat bázové složky vektoru \mathbf{c} , tj. $c_j = 0$ pro $j \in J$
 (vždy přičti k účelovému řádku násobek řádku, který má ve sloupci j jedničku).

$$\begin{array}{rcl}
 [\mathbf{c}^T & d] = & 0 & 1 & -2 & 0 & 0 & -1 & 3 \\
 & & 0 & 2 & 6 & 1 & 0 & 4 & 4 \\
 [\mathbf{A} & \mathbf{b}] = & 1 & 1 & 3 & 0 & 0 & 2 & 3 \\
 & & 0 & -1 & 1 & 0 & 1 & 2 & 1 \\
 \\
 \mathbf{x} = & & 3 & 0 & 0 & 4 & 1 & 0 &
 \end{array}$$

- ▶ Protože $x_j = 0$ pro $j \notin J$, je jednoduše $\mathbf{c}^T \mathbf{x} - d = -d$.
- ▶ Ihned vidíme, co by udělal vstup sloupce $j \notin J$ do báze:
 - ▶ když $c_j > 0$, účelová hodnota by stoupla
 - ▶ když $c_j < 0$, účelová hodnota by klesla
 (za předpokladu, že nové bázové řešení nebude degenerované, tj. $x_j > 0$).
- ▶ Jestliže v některém sloupci j je $c_j < 0$ a $a_{ij} \leq 0$ pro všechna i , účelovou funkci můžeme libovolně zmenšovat \Rightarrow úloha je neomezená.

Vstup i výstup iterace je simplexová tabulka splňující:

- ▶ podmnožina sloupců \mathbf{A} tvoří standardní bázi J
- ▶ $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$
- ▶ $c_j = 0$ pro $j \in J$ (ceny jsou redukované).

Vstup i výstup iterace je simplexová tabulka splňující:

- ▶ podmnožina sloupců \mathbf{A} tvoří standardní bázi J
- ▶ $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$
- ▶ $c_j = 0$ pro $j \in J$ (ceny jsou redukované).

Iterace se provede takto:

- 1 Vyber index j pivotu tak, aby $c_j < 0$.
- 2 Vyber index i pivotu tak, aby nové bázevé řešení bylo přípustné, tedy (promyslete!)

$$i \in \operatorname{argmin}_{i' \mid a_{i'j} > 0} \frac{b_{i'}}{a_{i'j}}$$

- 3 Udělej ekv. úpravu okolo pivotu (i, j) .
- 4 Ekv. úpravou účelového řádku vynuluj c_j v novém bázevé sloupci j .

Vstup i výstup iterace je simplexová tabulka splňující:

- ▶ podmnožina sloupců \mathbf{A} tvoří standardní bázi J
- ▶ $\mathbf{b} \geq \mathbf{0}$
- ▶ $c_j = 0$ pro $j \in J$ (ceny jsou redukované).

Iterace se provede takto:

- 1 Vyber index j pivotu tak, aby $c_j < 0$.
- 2 Vyber index i pivotu tak, aby nové báze řešení bylo přípustné, tedy (promyslete!)

$$i \in \operatorname{argmin}_{i' \mid a_{i'j} > 0} \frac{b_{i'}}{a_{i'j}}$$

- 3 Udělej ekv. úpravu okolo pivotu (i, j) .
- 4 Ekv. úpravou účelového řádku vynuluj c_j v novém báze sloupci j .

Algoritmus končí, když je splněna jedna z podmínek:

- ▶ Všechny c_j jsou nezáporné. Jsme v optimu.
- ▶ V každém sloupci j , kde $c_j < 0$, je $a_{ij} \leq 0$ pro všechna i . Úloha je neomezená.

$$\begin{array}{cccccc|c} 0 & -2 & 1 & 0 & 0 & -3 & 0 \\ \hline 0 & 2 & 6 & 1 & 0 & 4 & 4 \\ 1 & 1 & 3 & 0 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & -1 & 1 & 0 & 1 & 2 & 1 \end{array}$$

0	-2	1	0	0	-3		0
0	2	6	1	0	4		4
1	1	3	0	0	2		3
0	-1	1	0	1	2		1

- 1 Vyber sloupec j pivotu dle znamének c_j .

0	-2	1	0	0	-3		0
0	2	6	1	0	4		4
1	1	3	0	0	2		3
0	-1	1	0	1	2		1

- 1 Vyber sloupec j pivotu dle znamének c_j .
- 2 Vyber řádek i pivotu nalezením argumentu minima z čísel $\frac{4}{4}, \frac{3}{2}, \frac{1}{2}$.

0	-2	1	0	0	-3		0
0	2	6	1	0	4		4
1	1	3	0	0	2		3
0	-1	1	0	1	2		1

- 1 Vyber sloupec j pivotu dle znamének c_j .
- 2 Vyber řádek i pivotu nalezením argumentu minima z čísel $\frac{4}{4}$, $\frac{3}{2}$, $\frac{1}{2}$.
- 3 Ekv. úpravami nastav pivot na 1 a prvky nad i pod pivotem (vč. ceny) na 0:

0	-2	1	0	0	-3	0
0	2	6	1	0	4	4
1	1	3	0	0	2	3
0	-.5	.5	0	.5	1	.5

- ① Vyber sloupec j pivotu dle znamének c_j .
- ② Vyber řádek i pivotu nalezením argumentu minima z čísel $\frac{4}{4}, \frac{3}{2}, \frac{1}{2}$.
- ③ Ekv. úpravami nastav pivot na 1 a prvky nad i pod pivotem (vč. ceny) na 0:
 - ▶ Vyděl pivotový řádek pivotem.

0	-2	1	0	0	-3		0
0	2	6	1	0	4		4
1	2	2	0	-1	0		2
0	-.5	.5	0	.5	1		.5

- ① Vyber sloupec j pivotu dle znamének c_j .
- ② Vyber řádek i pivotu nalezením argumentu minima z čísel $\frac{4}{4}$, $\frac{3}{2}$, $\frac{1}{2}$.
- ③ Ekv. úpravami nastav pivot na 1 a prvky nad i pod pivotem (vč. ceny) na 0:
 - ▶ Vyděl pivotový řádek pivotem.
 - ▶ Ke každému nepivotovému řádku přičti vhodný násobek pivotového řádku.

0	-2	1	0	0	-3		0
0	4	4	1	-2	0		2
1	2	2	0	-1	0		2
0	-.5	.5	0	.5	1		.5

- ① Vyber sloupec j pivotu dle znamének c_j .
- ② Vyber řádek i pivotu nalezením argumentu minima z čísel $\frac{4}{4}$, $\frac{3}{2}$, $\frac{1}{2}$.
- ③ Ekv. úpravami nastav pivot na 1 a prvky nad i pod pivotem (vč. ceny) na 0:
 - ▶ Vyděl pivotový řádek pivotem.
 - ▶ Ke každému nepivotovému řádku přičti vhodný násobek pivotového řádku.

0	-3.5	2.5	0	1.5	0	1.5
0	4	4	1	-2	0	2
1	2	2	0	-1	0	2
0	-.5	.5	0	.5	1	.5

- ① Vyber sloupec j pivotu dle znamének c_j .
- ② Vyber řádek i pivotu nalezením argumentu minima z čísel $\frac{4}{4}$, $\frac{3}{2}$, $\frac{1}{2}$.
- ③ Ekv. úpravami nastav pivot na 1 a prvky nad i pod pivotem (vč. ceny) na 0:
 - ▶ Vyděl pivotový řádek pivotem.
 - ▶ Ke každému nepivotovému řádku přičti vhodný násobek pivotového řádku.

Hotovo, tabulka je připravena na další iteraci.