

# Optimisation

## Programmation linéaire

Louis-Claude Canon  
[louis-claude.canon@univ-fcomte.fr](mailto:louis-claude.canon@univ-fcomte.fr)

Master 2 Informatique – Semestre 9

# Plan

Exemple introductif

Formulations et algorithmes

Formulation de problèmes de graphes comme programmes linéaires

Conclusion

# Plan

Exemple introductif

Formulations et algorithmes

Formulation de problèmes de graphes comme programmes linéaires

Conclusion

## Problème politique

- ▶ Un politicien souhaite remporter une élection sur une circonscription.
- ▶ La circonscription comprend 3 zones : ville (100 000 électeurs), banlieues (200 000) et campagne (50 000).
- ▶ Pour être légitime, le politicien souhaite au moins la moitié des voix dans chaque zone.
- ▶ L'objectif est de dépenser le moins possible de frais en publicité.

## Données du problème

Nombre de milliers d'électeurs gagnés pour 1000 € dépensés en publicité :

Stratégie	ville	banlieues	campagne
Apocalypse zombie	-2	5	3
Requins avec laser	8	2	-5
Autoroutes pour voitures volantes	0	0	10
Vote des dauphins	10	0	-2

## Exemple de solution

On peut dépenser :

- ▶ 20 000 € pour la préparation à une apocalypse zombie,
- ▶ 0 € pour l'équipement de laser sur des requins,
- ▶ 4 000 € pour construire des autoroutes pour voitures volantes,
- ▶ 9 000 € pour permettre aux dauphins de voter.

Dans ce cas, on obtient :

- ▶ 50 000 électeurs en ville (sur 100 000),
- ▶ 100 000 électeurs en banlieues (sur 200 000),
- ▶ 82 000 électeurs en campagne (sur 50 000).

Le coût total serait de 33 000 euros.

## Exemple de solution

On peut dépenser :

- ▶ 20 000 € pour la préparation à une apocalypse zombie,
- ▶ 0 € pour l'équipement de laser sur des requins,
- ▶ 4 000 € pour construire des autoroutes pour voitures volantes,
- ▶ 9 000 € pour permettre aux dauphins de voter.

Dans ce cas, on obtient :

- ▶ 50 000 électeurs en ville (sur 100 000),
- ▶ 100 000 électeurs en banlieues (sur 200 000),
- ▶ 82 000 électeurs en campagne (sur 50 000).

Le coût total serait de 33 000 euros. **Est-ce optimal ?**

# Terminologie

- ▶ Il faut formuler mathématiquement le problème (on dit aussi le *modéliser*).
- ▶ On a 4 *variables* pour décider les sommes investies : une par stratégie. Ce sera  $x_1$  à  $x_4$  (e.g.,  $x_1$  étant le budget pour l'apocalypse zombie).
- ▶ On a des *contraintes* sur le nombre d'électeurs obtenus : une par zone de la circonscription. Par exemple pour la ville :  $-2x_1 + 8x_2 + 0x_3 + 10x_4 \geq 50$ .
- ▶ On définit l'*objectif* : minimiser la somme totale investie (ici,  $x_1 + x_2 + x_3 + x_4$ ).



## Exemple de programme linéaire

Le programme linéaire ainsi obtenu est :

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & x_1 + x_2 + x_3 + x_4 \\
 \text{sous les contraintes} & -2x_1 + 8x_2 + 0x_3 + 10x_4 \geq 50 \\
 & 5x_1 + 2x_2 + 0x_3 + 0x_4 \geq 100 \\
 & 3x_1 - 5x_2 + 10x_3 - 2x_4 \geq 25 \\
 & x_1, x_2, x_3, x_4 \geq 0
 \end{array}$$

# Plan

Exemple introductif

**Formulations et algorithmes**

Formulation de problèmes de graphes comme programmes linéaires

Conclusion

# Fonction linéaire

- ▶ Soit  $a_1, a_2, \dots, a_n$  des valeurs réelles.
- ▶ Soit  $x_1, x_2, \dots, x_n$  des variables réelles.
- ▶ Une *fonction linéaire*  $f$  est définie par :

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) = a_1x_1 + a_2x_2 + \dots + a_nx_n = \sum_{j=1}^n a_jx_j$$

- ▶ Exemple :  $f(x_1, x_2) = 2x_1 - x_2$ .
- ▶ Une *égalité linéaire* (avec  $b$  une valeur réelle) :  $f(x_1, x_2, \dots, x_n) = b$ .
- ▶ Les *inégalités linéaires* :  $f(x_1, x_2, \dots, x_n) \leq b$  et  $f(x_1, x_2, \dots, x_n) \geq b$ .
- ▶ Une *contrainte linéaire* est soit une égalité, soit une inégalité linéaire.

## Problème de programmation linéaire

- ▶ Un *problème de programmation linéaire* consiste à minimiser ou maximiser une fonction linéaire soumise à des contraintes linéaires.
- ▶ Soit  $n$  le nombre de variables et  $m$  le nombre de contraintes.
- ▶ On cherche les valeurs des variables  $x_1, x_2, \dots, x_n$  pour :

$$\begin{aligned} &\text{maximiser} && \sum_{j=1}^n c_j x_j \\ &\text{sous les contraintes} && \sum_{j=1}^n a_{ij} x_j \leq b_i \text{ pour } i = 1, 2, \dots, m \\ &&& x_j \geq 0 \text{ pour } j = 1, 2, \dots, n \end{aligned}$$

- ▶ Les  $c_j$  sont les coefficients réels de la *fonction objectif*.
- ▶ Les  $a_{ij}$  et  $b_i$  sont les coefficients réels des *contraintes*.
- ▶ La dernière ligne représente les contraintes de non-négativité.

## Forme standard

La *forme standard* utilise une forme plus compacte en utilisant une matrice  $A$  (qui contient les  $a_{ij}$ ) et 3 vecteurs colonnes  $b$  ( $b_i$ ),  $c$  ( $c_j$ ) et  $x$  ( $x_j$ ) :

$$\begin{array}{ll}\text{maximiser} & c^T x \\ \text{sous les contraintes} & Ax \leq b \\ & x \geq 0\end{array}$$

Les bibliothèques de résolution s'appuient souvent sur cette forme.

# Solutions

- ▶ Soit  $\bar{x}$  un ensemble de valeurs réelles pour le vecteur  $x$ .
- ▶ Si les contraintes sont respectées,  $\bar{x}$  est une *solution réalisable* et sa *valeur de l'objectif* est  $c^T \bar{x}$ .
- ▶ S'il n'existe pas de solution avec un meilleur objectif, on dit que c'est la *solution optimale* et qu'elle atteint la *valeur de l'objectif optimale*.

## Résolution sur un exemple

On considère le problème de programmation linéaire suivant :

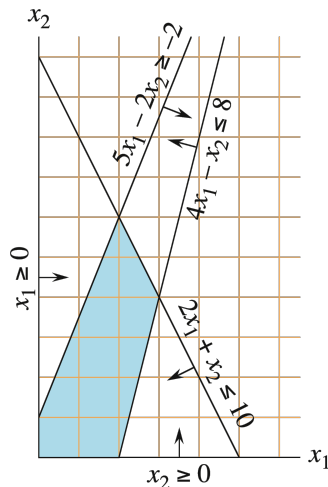
$$\begin{array}{llllll}
 \text{maximiser} & x_1 & + & x_2 & & \\
 \text{sous les contraintes} & 4x_1 & - & x_2 & \leq & 8 \\
 & 2x_1 & + & x_2 & \leq & 10 \\
 & 5x_1 & - & 2x_2 & \geq & -2 \\
 & & & x_1, x_2 & \geq & 0
 \end{array}$$

# Représentation graphique (1/2)

- Les contraintes sont définies par la matrice

$$A = \begin{pmatrix} 4 & -1 \\ 2 & 1 \\ -5 & 2 \end{pmatrix} \text{ et le vecteur } b = \{8, 10, 2\}.$$

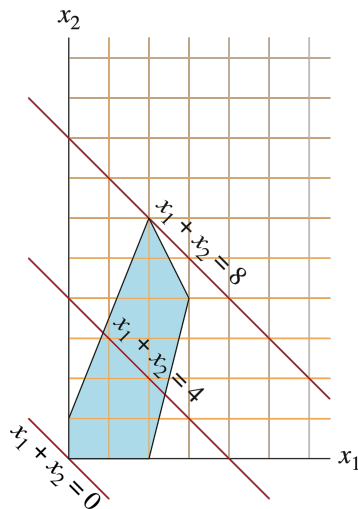
- Les 5 contraintes définissent un polygone, c'est-à-dire une région de réalisabilité (toute solution dans cette région est réalisable).





## Représentation graphique (2/2)

- ▶ La fonction objectif est  $f(x_1, x_2) = x_1 + x_2$  avec  $c_1 = c_2 = 1$ .
- ▶ La solution  $\bar{x} = \{0, 0\}$  est réalisable et sa valeur de l'objectif est 0.
- ▶ La solution optimale est  $\bar{x} = \{2, 6\}$  et la valeur de l'objectif optimale est 8.



## Algorithme du simplexe

- ▶ L'algorithme du simplexe est très efficace en pratique pour résoudre les problèmes de programmation linéaire (bien que de complexité exponentielle en temps au pire cas).
- ▶ Il part d'une solution réalisable ( $\bar{x} = 0$  par exemple) et se déplace de sommet en sommet sur les bords du polyèdre (polygone en dimension  $n$ ) formant la région de réalisabilité.
- ▶ Il s'arrête sur la solution optimale.
- ▶ D'autres méthodes, de complexité en temps polynomiale, se déplacent à l'intérieur de la région de réalisabilité (méthodes de points intérieurs).
- ▶ En pratique, on s'appuie sur un solveur comme CPLEX ou COIN-OR LP qui peuvent traiter des centaines de milliers de variables et de contraintes.

# Gestion des valeurs réelles

- ▶ En informatique, les valeurs réelles n'existent pas.
- ▶ Souvent, on utilise simplement des nombres flottants (simple ou double précision).
- ▶ C'est une approximation souvent suffisante mais qui est sensible à des problèmes de stabilité numérique.
- ▶ Il faut donc garder en tête la vérification du résultat.

## Question

Lequel de ces programmes linéaires n'admet pas de solution réalisable ?

1.

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & -2x_1 + 3x_2 \\
 \text{contraintes} & x_1 + x_2 = 7 \\
 & x_1 - 2x_2 \leq 4 \\
 & x_1 \geq 0
 \end{array}$$

2.

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & 2x_1 + x_2 \\
 \text{contraintes} & x_1 - x_2 = 7 \\
 & 3x_1 \geq 24 \\
 & x_2 \geq 0
 \end{array}$$

3.

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & 3x_1 - 2x_2 \\
 \text{contraintes} & x_1 + x_2 \leq 2 \\
 & -2x_1 - 2x_2 \leq -10 \\
 & x_1, x_2 \geq 0
 \end{array}$$

4.

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & x_1 - x_2 \\
 \text{contraintes} & -2x_1 + x_2 \leq -1 \\
 & -x_1 - 2x_2 \leq -2 \\
 & x_1, x_2 \geq 0
 \end{array}$$

## Question

Lequel de ces programmes linéaires n'admet pas de solution réalisable ?

1.

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & -2x_1 + 3x_2 \\
 \text{contraintes} & x_1 + x_2 = 7 \\
 & x_1 - 2x_2 \leq 4 \\
 & x_1 \geq 0
 \end{array}$$

2.

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & 2x_1 + x_2 \\
 \text{contraintes} & x_1 - x_2 = 7 \\
 & 3x_1 \geq 24 \\
 & x_2 \geq 0
 \end{array}$$

3. ✓

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & 3x_1 - 2x_2 \\
 \text{contraintes} & x_1 + x_2 \leq 2 \\
 & -2x_1 - 2x_2 \leq -10 \\
 & x_1, x_2 \geq 0
 \end{array}$$

4.

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & x_1 - x_2 \\
 \text{contraintes} & -2x_1 + x_2 \leq -1 \\
 & -x_1 - 2x_2 \leq -2 \\
 & x_1, x_2 \geq 0
 \end{array}$$

# Plan

Exemple introductif

Formulations et algorithmes

Formulation de problèmes de graphes comme programmes linéaires

Conclusion

## Problèmes concernés

- ▶ La *recherche opérationnelle* est une discipline qui se base sur la formulation mathématique des problèmes d'optimisation.
- ▶ Exemples : gestion d'emploi du temps avec contraintes, organisation de chaînes logistiques, affectation de ressources, etc.
- ▶ On peut notamment formuler des problèmes de graphes et de flots comme des programmes linéaires.

# Notation ensembliste

## Notion mathématique

$V = \{u, v, w\}$  Ensemble  $V$  contenant 3 éléments :  $u$ ,  $v$  et  $w$ .

$v \in V$  L'appartenance à un ensemble se note  $\in$ .

$|V|$  Nombre d'éléments, ou cardinalité, de l'ensemble  $V$  (ici nombre de sommets).  
Pour les complexités cependant, on simplifiera  $O(|V|) = O(V)$  et  
 $O(|E|) = O(E)$ .

$\emptyset$  Ensemble vide.

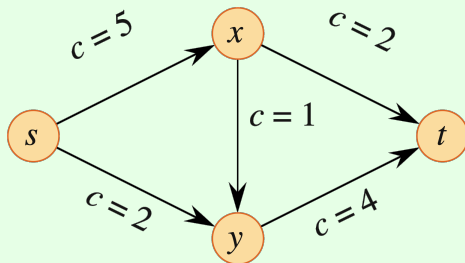
$A \setminus B$  Opération de différence sur les ensembles (ce qui est dans  $A$  mais pas dans  $B$ ).



# Flot maximum : description

## Notion algorithmique

- ▶ Un graphe orienté  $G = (V, E)$  avec des capacités sur les arcs  $c : V \times V \rightarrow \mathbb{R}$ .
- ▶ Un sommet source  $s \in V$  et un puits  $t \in V$ .
- ▶ Soit  $f : V \times V \rightarrow \mathbb{R}$  le flot de chaque arc.
- ▶ On cherche à maximiser le flot total provenant de la source.
- ▶ Le flot doit respecter les contraintes de capacité et se conserver.



# Flot maximum : programme linéaire

$$\begin{array}{ll}
 \text{maximiser} & \sum_{v \in V} f_{sv} - \sum_{v \in V} f_{vs} \\
 \text{sous les contraintes} & f_{uv} \leq c(u, v) \text{ pour chaque } u, v \in V \\
 & \sum_{v \in V} f_{uv} = \sum_{v \in V} f_{vu} \text{ pour chaque } u \in V \setminus \{s, t\} \\
 & f_{uv} \geq 0 \quad \text{pour chaque } u, v \in V
 \end{array}$$

- ▶ La première contrainte garantit les capacités.
- ▶ La seconde contrainte concerne la conservation du flot.
- ▶ Nombre de variables :  $|V|^2$ .
- ▶ Nombre de contraintes :  $2|V|^2 + |V| - 2$ .

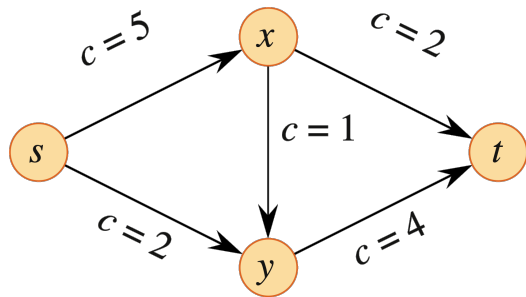
## Flot maximum : programme linéaire

$$\begin{array}{ll}
 \text{maximiser} & \sum_{v \in V} f_{sv} - \sum_{v \in V} f_{vs} \\
 \text{sous les contraintes} & f_{uv} \leq c(u, v) \text{ pour chaque } u, v \in V \\
 & \sum_{v \in V} f_{uv} = \sum_{v \in V} f_{vu} \text{ pour chaque } u \in V \setminus \{s, t\} \\
 & f_{uv} \geq 0 \quad \text{pour chaque } u, v \in V
 \end{array}$$

- ▶ La première contrainte garantit les capacités.
- ▶ La seconde contrainte concerne la conservation du flot.
- ▶ Nombre de variables :  $|V|^2$ .
- ▶ Nombre de contraintes :  $2|V|^2 + |V| - 2$ .

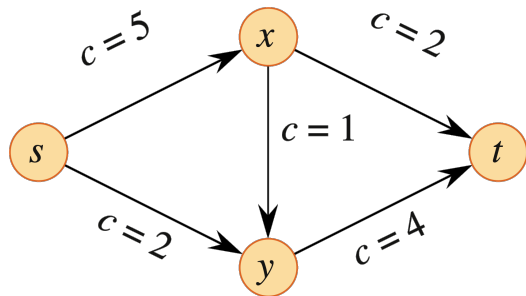
## Flot maximum : exemple

$$\begin{array}{ll}
 \text{maximiser} & f_{sx} + f_{sy} \\
 \text{sous les contraintes} & 0 \leq f_{sx} \leq 5 \\
 & 0 \leq f_{sy} \leq 2 \\
 & 0 \leq f_{xy} \leq 1 \\
 & 0 \leq f_{xt} \leq 2 \\
 & 0 \leq f_{yt} \leq 4 \\
 & f_{sx} = f_{xy} + f_{xt} \\
 & f_{sy} + f_{xy} = f_{yt}
 \end{array}$$



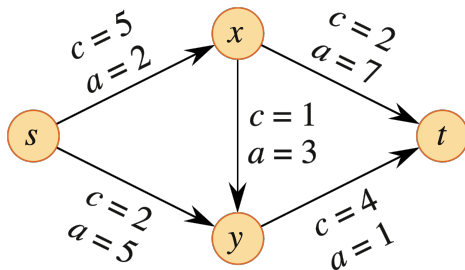
## Flot maximum : solution

- ▶  $\bar{f}_{sx} = 3.$
- ▶  $\bar{f}_{sy} = 2.$
- ▶  $\bar{f}_{xy} = 1.$
- ▶  $\bar{f}_{xt} = 2.$
- ▶  $\bar{f}_{yt} = 3.$



## Flot maximum à coût minimal : description

- ▶ Les deux problèmes précédents peuvent déjà être résolus par des algorithmes existants.
- ▶ L'approche par la programmation linéaire permet traiter de nouveaux problèmes.
- ▶ On modifie le problème du flot maximum en rajoutant des coûts sur les arcs ( $a : E \rightarrow \mathbb{R}$ ).
- ▶ On souhaite alors minimiser le coût ( $\sum_{(u,v) \in E} a(u,v) \times f_{uv}$ ) en garantissant un flot minimum  $d$ .



# Flot maximum à coût minimal : programme linéaire

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & \sum_{(u,v) \in E} a(u,v) \times f_{uv} \\
 \text{sous les contraintes} & f_{uv} \leq c(u,v) \text{ pour chaque } u, v \in V \\
 & \sum_{v \in V} f_{uv} - \sum_{v \in V} f_{vu} = 0 \quad \text{pour chaque } u \in V \setminus \{s, t\} \\
 & \sum_{v \in V} f_{sv} - \sum_{v \in V} f_{vs} = d \\
 & f_{uv} \geq 0 \quad \text{pour chaque } u, v \in V
 \end{array}$$

- ▶ Nombre de variables :  $|V|^2$ .
- ▶ Nombre de contraintes :  $2|V|^2 + |V| - 1$ .

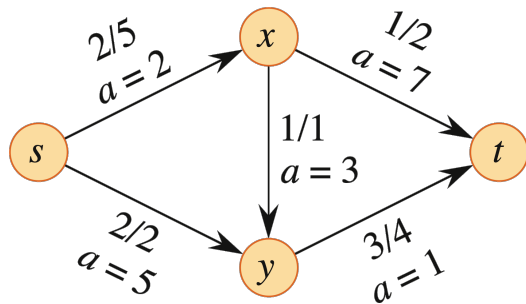
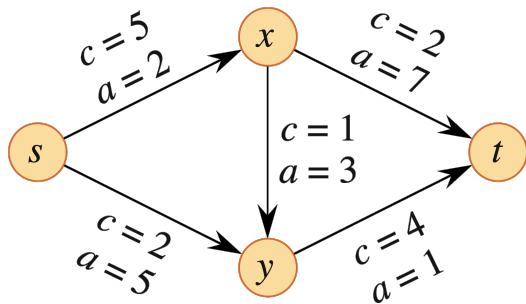
## Flot maximum à coût minimal : programme linéaire

$$\begin{array}{ll}
 \text{minimiser} & \sum_{(u,v) \in E} a(u,v) \times f_{uv} \\
 \text{sous les contraintes} & f_{uv} \leq c(u,v) \text{ pour chaque } u, v \in V \\
 & \sum_{v \in V} f_{uv} - \sum_{v \in V} f_{vu} = 0 \quad \text{pour chaque } u \in V \setminus \{s, t\} \\
 & \sum_{v \in V} f_{sv} - \sum_{v \in V} f_{vs} = d \\
 & f_{uv} \geq 0 \quad \text{pour chaque } u, v \in V
 \end{array}$$

- ▶ Nombre de variables :  $|V|^2$ .
- ▶ Nombre de contraintes :  $2|V|^2 + |V| - 1$ .



## Flot maximum : exemple



## Flot multi-produits : contexte

- ▶ L'entreprise Max & Fils produit et livre des tissus, des pots et des fleurs artificielles.
- ▶ Chaque type de produits est fabriqué dans une usine spécifique puis expédié chaque jour vers son entrepôt.
- ▶ Les différents types de produit doivent se partager le réseau de transport.

## Flot multi-produits : description

- ▶ Un graphe orienté  $G = (V, E)$  avec des capacités sur les arcs  $c : E \rightarrow \mathbb{R}$ .
- ▶ Il y a  $k$  produits différents chacun spécifié par  $s_i$  (son usine),  $t_i$  (son entrepôt) et  $d_i$  (la quantité de produit, c'est-à-dire le flot souhaité).
- ▶ Soit  $f_{iuv}$  le flot pour chaque produit sur chaque arc.
- ▶ Le flot total est la somme des flots de chaque produit  $f_{uv} = \sum_{i=1}^k f_{iuv}$ .
- ▶ On cherche à déterminer si une solution existe.

# Flot multi-produits : programme linéaire

minimiser

0

sous les contraintes

$$\sum_{i=1}^k f_{iuv} \leq c(u, v) \text{ pour chaque } u, v \in V$$

$$\sum_{v \in V} f_{iuv} - \sum_{v \in V} f_{ivu} = 0 \quad \text{pour chaque } i = 1, 2, \dots, k \text{ et}$$

pour chaque  $u \in V \setminus \{s, t\}$

$$\sum_{v \in V} f_{i,s_i,v} - \sum_{v \in V} f_{i,v,s_i} = d_i \quad \text{pour chaque } i = 1, 2, \dots, k$$

$$f_{iuv} \geq 0 \quad \text{pour chaque } i = 1, 2, \dots, k \text{ et}$$

pour chaque  $u, v \in V$

## Question

Lequel de ces programmes linéaires résout le problème de flot maximum ?

1.

$$\begin{aligned}
 &\text{maximiser} && \sum_{v \in V} f_{sv} \\
 &\text{contraintes} && f_{uv} \leq c(u, v) \quad \forall u, v \in V \\
 & && \sum_{v \in V} f_{uv} = \sum_{v \in V} f_{vu} \quad \forall u \in V \setminus \{s, t\} \\
 & && f_{uv} \geq 0 \quad \forall u, v \in V
 \end{aligned}$$

2.

$$\begin{aligned}
 &\text{minimiser} && \sum_{(u,v) \in E} a(u, v) \times f_{uv} \\
 &\text{contraintes} && f_{uv} \leq c(u, v) \quad \forall u, v \in V \\
 & && \sum_{v \in V} f_{uv} - \sum_{v \in V} f_{vu} = 0 \quad \forall u \in V \setminus \{s, t\} \\
 & && \sum_{v \in V} f_{sv} - \sum_{v \in V} f_{vs} = d \\
 & && f_{uv} \geq 0 \quad \forall u, v \in V
 \end{aligned}$$

3.

$$\begin{aligned}
 &\text{maximiser} && d_t \\
 &\text{contraintes} && d_v \leq d_u + w(u, v) \quad \forall (u, v) \in E \\
 & && d_s = 0
 \end{aligned}$$

4.

$$\begin{aligned}
 &\text{minimiser} && \sum_{(u,v) \in E} c(u, v) \times d_{uv} \\
 &\text{contraintes} && d_{uv} - z_u + z_v \geq 0 \quad \forall (u, v) \in E, u \neq s, v \neq t \\
 & && d_{sv} + z_v \geq 1 \quad \forall (s, v) \in E, v \neq t \\
 & && d_{ut} - z_u \geq 0 \quad \forall (u, t) \in E, u \neq s \\
 & && d_{st} \geq 1 \quad \text{si } (s, t) \in E \\
 & && d_{uv} \geq 0 \quad \forall (u, v) \in E
 \end{aligned}$$

## Question

Lequel de ces programmes linéaires résout le problème de flot maximum ?

1. ✓

$$\begin{aligned}
 &\text{maximiser} && \sum_{v \in V} f_{sv} \\
 &\text{contraintes} && f_{uv} \leq c(u, v) \quad \forall u, v \in V \\
 &&& \sum_{v \in V} f_{uv} = \sum_{v \in V} f_{vu} \quad \forall u \in V \setminus \{s, t\} \\
 &&& f_{uv} \geq 0 \quad \forall u, v \in V
 \end{aligned}$$

2.

$$\begin{aligned}
 &\text{minimiser} && \sum_{(u,v) \in E} a(u, v) \times f_{uv} \\
 &\text{contraintes} && f_{uv} \leq c(u, v) \quad \forall u, v \in V \\
 &&& \sum_{v \in V} f_{uv} - \sum_{v \in V} f_{vu} = 0 \quad \forall u \in V \setminus \{s, t\} \\
 &&& \sum_{v \in V} f_{sv} - \sum_{v \in V} f_{vs} = d \\
 &&& f_{uv} \geq 0 \quad \forall u, v \in V
 \end{aligned}$$

3.

$$\begin{aligned}
 &\text{maximiser} && d_t \\
 &\text{contraintes} && d_v \leq d_u + w(u, v) \quad \forall (u, v) \in E \\
 &&& d_s = 0
 \end{aligned}$$

4.

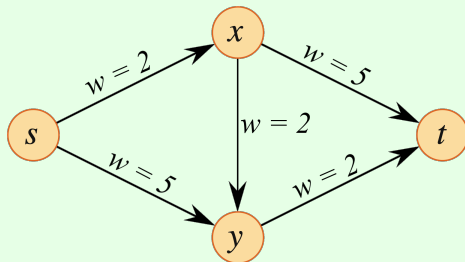
$$\begin{aligned}
 &\text{minimiser} && \sum_{(u,v) \in E} c(u, v) \times d_{uv} \\
 &\text{contraintes} && d_{uv} - z_u + z_v \geq 0 \quad \forall (u, v) \in E, u \neq s, v \neq t \\
 &&& d_{sv} + z_v \geq 1 \quad \forall (s, v) \in E, v \neq t \\
 &&& d_{ut} - z_u \geq 0 \quad \forall (u, t) \in E, u \neq s \\
 &&& d_{st} \geq 1 \quad \text{si } (s, t) \in E \\
 &&& d_{uv} \geq 0 \quad \forall (u, v) \in E
 \end{aligned}$$

✓(problème dual de coupe minimum)

# Plus courts chemins : description

## Notion algorithmique

- ▶ Un graphe orienté  $G = (V, E)$  avec une pondération sur les arcs  $w : E \rightarrow \mathbb{R}$ .
- ▶ Un sommet source  $s \in V$  et une destination  $t \in V$ .
- ▶ Soit  $d_v$  le poids du plus court chemin de  $s$  vers  $v$  ( $d_s = 0$ ).
- ▶ On cherche  $d_t$ .



## Plus courts chemins : programme linéaire

$$\begin{array}{ll}\text{maximiser} & d_t \\ \text{sous les contraintes} & d_v \leq d_u + w(u, v) \text{ pour tout arc } (u, v) \in E \\ & d_s = 0\end{array}$$

- ▶ Si c'était une minimisation,  $d_t = -\infty$  serait une solution optimale.
- ▶ Astuce : c'est l'inégalité triangulaire qui garantit une valeur maximale aux variables.
- ▶ Nombre de variables :  $|V|$ .
- ▶ Nombre de contraintes :  $|E| + 1$ .



## Plus courts chemins : programme linéaire

$$\begin{array}{ll} \text{maximiser} & d_t \\ \text{sous les contraintes} & d_v \leq d_u + w(u, v) \text{ pour tout arc } (u, v) \in E \\ & d_s = 0 \end{array}$$

- ▶ Si c'était une minimisation,  $d_t = -\infty$  serait une solution optimale.
- ▶ Astuce : c'est l'inégalité triangulaire qui garantit une valeur maximale aux variables.
- ▶ Nombre de variables :  $|V|$ .
- ▶ Nombre de contraintes :  $|E| + 1$ .

## Plus courts chemins : exemple

maximiser  $d_t$   
 sous les contraintes

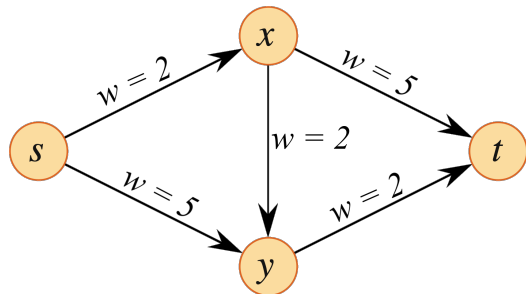
$$d_x \leq d_s + 2$$

$$d_y \leq d_s + 5$$

$$d_y \leq d_x + 2$$

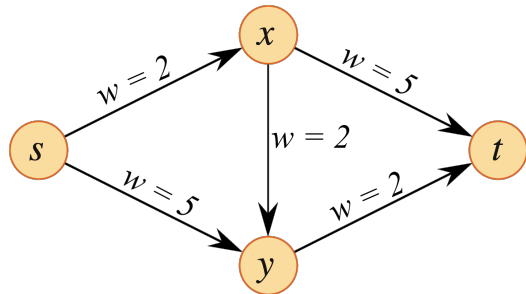
$$d_t \leq d_x + 5$$

$$d_t \leq d_y + 2$$

$$d_s = 0$$


## Plus courts chemins : solution

- ▶  $\bar{d}_s = 0.$
- ▶  $\bar{d}_x = 2.$
- ▶  $\bar{d}_y = 4.$
- ▶  $\bar{d}_t = 6.$



# Plan

Exemple introductif

Formulations et algorithmes

Formulation de problèmes de graphes comme programmes linéaires

Conclusion

# Résumé

- ▶ La formulation d'un problème comme programme linéaire consiste à le modéliser avec des contraintes et une fonction objectif qui sont des sommes pondérées des variables que l'on souhaite déterminer.
- ▶ La programmation linéaire permet de traiter de nombreux problèmes d'optimisation combinatoire.
- ▶ Des outils efficaces permettent de résoudre des programmes avec de nombreuses variables et contraintes.
- ▶ Un problème de programmation linéaire peut s'adapter facilement en modifiant sa formulation.

## Prochaines échéances

- ▶ Début du projet-tournoi le 23/9.
- ▶ Premier rendu intermédiaire du projet-tournoi le 6/10.
- ▶ Second rendu intermédiaire du projet-tournoi le 20/10.
- ▶ Épreuve sur table le 23/10.
- ▶ Rendu final pour le projet-tournoi le 4/11.
- ▶ Épreuve de TP le 5/11.
- ▶ Restitution du projet-tournoi le 6/11.