

Н.Н. Петров

МЕТОДЫ ОПТИМИЗАЦИИ
В ЗАДАЧАХ И УПРАЖНЕНИЯХ

Ижевск 2008

Федеральное агентство по образованию
Государственное образовательное учреждение высшего
профессионального образования
«Удмуртский государственный университет»

Н.Н.ПЕТРОВ

МЕТОДЫ ОПТИМИЗАЦИИ В ЗАДАЧАХ И УПРАЖНЕНИЯХ

Учебное пособие

Рекомендовано УМС по математике и механике УМО
по классическому университетскому образованию РФ
в качестве учебного пособия для студентов высших
учебных заведений, обучающихся по направлениям
и специальностям: «Математика», «Механика»,
«Прикладная математика и информатика».

Ижевск 2008

УДК 519.8
ББК 22.18
П 30

Петров Н.Н.

П 30. Методы оптимизации в задачах и упражнениях: Учебное пособие. Ижевск, 2008. 137с.

Пособие содержит 23 варианта индивидуальных заданий для самостоятельной работы студентов по курсу «Методы оптимизации».

© Петров Н.Н., 2008

© Удмуртский государственный университет, 2008

ПРЕДИСЛОВИЕ

Курс «Методы оптимизации» принадлежит к числу обязательных общеобразовательных математических дисциплин, определяющих профессиональное назначение специалистов-математиков, обучающихся в университете.

Пособие написано на основе лекций и практических занятий, которые автор проводил в течение более десяти лет на математическом факультете Удмуртского государственного университета.

Многие практические задачи, будучи формализованными в математической форме, состоят в нахождении минимума или максимума некоторой функции или функционала с учетом ограничений, накладываемых на допустимые значения переменных. Такие задачи называют экстремальными.

Изучение любого курса, в том числе и «Методы оптимизации», предполагает сопровождение лек

чем в каждый из них надлежит завезти соответственно $b_1, \dots, b_n$ единиц груза. Стоимость перевозки единицы груза из A_i в B_j равна c_{ij} . При этом, если $\sum_i a_i \leq \sum_j b_j$, то требуется вывезти весь груз от производителей. Если $\sum_i a_i > \sum_j b_j$, то требуется выполнить все заявки потребителей. Требуется составить план перевозок, суммарные расходы которого минимальны. Пусть $a = (a_1, \dots, a_m)$, $b = (b_1, \dots, b_n)$, $C = (c_{ij})$.

Задача о рюкзаке. Имеется n предметов, a_j — вес, b_j — ценность j -го предмета, $a_j > 0, b_j > 0$. Требуется загрузить рюкзак, выдерживающий суммарный вес s набором предметов, суммарная ценность которых максималь

Список литературы, которую автор использовал для написания данного пособия, приведен в конце. Кроме того, данный список можно рекомендовать для дальнейшего знакомства с математической теорией оптимизации и для ее серьезного изучения.

Автор будет благодарен всем читателям за советы и пожелания по поводу пособия, которые просьба направлять по e-mail: `prpetrov@udmnet.ru` или обычной почтой по адресу: 426034, Ижевск, ул. Университетская, д. 1, Удмуртский университет, математический факультет.

Автор выражает благодарность М. В. Чибиревой за помощь при оформлении, а также А. И. Благодатских и К. И. Дизендорфу за многочисленные рекомендации по улучшению качества пособия.

ЧАСТЬ I

Вариант 1

1. $x_1^4 + x_2^4 - 2x_1^2 + 4x_1x_2 - 2x_2^2 \rightarrow \text{extr.}$
2. $x^2 + 12xy + 2y^2 \rightarrow \text{extr, } y^2 + 4x^2 = 25.$
3. $x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_n^2 \rightarrow \text{extr, } x_1^4 + x_2^4 + \dots + x_n^4 \leq 1.$
4. $\frac{\alpha_1}{x_1} + \frac{\alpha_2}{x_2} + \dots + \frac{\alpha_n}{x_n} \rightarrow \text{extr, } \beta_1x_1 + \beta_2x_2 + \dots + \beta_nx_n \leq 1, \alpha_i \geq 0.$
5. $y^2 \rightarrow \text{extr, } 9x^3 + 2y^3 - 27xy \geq -16.$
<

15. $x_1 + x_2 + x_3 \rightarrow \max, x_i \geq 0, \begin{cases} x_1 + x_2 + x_3 + x_4 = 2, \\ x_1 - x_2 + x_3 - x_4 = 0, \\ 3x_1 - x_2 + 3x_3 - x_4 = 2. \end{cases}$
16. При каких значениях параметра k точка $(-3, 4)$ является решением задачи
- $$kx_1 + (2 - k)x_2 \rightarrow \max, \begin{cases} 4x_1 - 3x_2 \leq 0, \\ 2x_1 + 3x_2 \leq 7, \\ x_1 + x_2 \leq 1? \end{cases}$$
17. Построить задачу, двойственную к следующей задаче линейного программирования:
- $$x_1 + 2x_2 \rightarrow \max, x_2 \geq 0, \begin{cases} 3x_1 - 4x_2 \geq 1, \\ 5x_1 + 6x_2 = 2, \\ -7x_1 + 8x_2 \leq 3. \end{cases}$$
18. $2x_1 + 3x_2 - x_3 + x_4 \rightarrow \min, x_i \geq 0, \begin{cases$

21. Решить задачу о коммивояжере с матрицей

$$C = \begin{pmatrix} \infty & 27 & 43 & 16 & 30 & 26 \\ 7 & \infty & 16 & 1 & 30 & 25 \\ 20 & 13 & \infty & 35 & 5 & 1 \\ 21 & 16 & 25 & \infty & 18 & 18 \\ 12 & 46 & 27 & 48 & \infty & 5 \\ 23 & 5 & 5 & 9 & 5 & \infty \end{pmatrix}.$$

22. 1. Методом потенциалов решить транспортную задачу

$$a = (7, 8, 5, 6), \quad b = (11, 2, 6, 7), \quad C = \begin{pmatrix$$

Вариант 2

1. $x^2 - xy + y^2 - 2x + y \rightarrow \text{extr.}$
2. $4x^2 + 9y^2 + 16z^2 \rightarrow \text{extr, } x + y + z = 1.$
3. $x_1^4 + x_2^4 + \dots + x_n^4 \rightarrow \text{extr, } x_1^2 + x_2^2 + \dots + x_n^2 \leq 1.$
4. $x_1^2 x_2^3 \dots x_n^{n+1} \rightarrow \text{extr, } x_1 + x_2 + \dots + x_n = 1.$
5. $5x + 4y \rightarrow \text{extr, } x^2 + 2y^2 \geq 72, x \geq 2, y \geq -3.$
6. Найти прямоугольный треугольник наибольшей площади, если сумма длин катетов равна заданному числу.
7. Найти расстояние от точки до гиперболы.
8. Вычислить $\max_{x \in [-1,$

15. $x_1 + x_2 + x_3 \rightarrow \max, x_i \geq 0, \begin{cases} x_1 + x_2 + x_3 + x_4 = 4, \\ x_1 - 3x_2 + x_3 - x_4 = -2, \\ 2x_1 - 2x_2 + 2x_3 = 2. \end{cases}$
16. При каких значениях параметра k точка $(2, 3)$ является решением задачи
- $$kx_1 + (2 - k)x_2 \rightarrow \max, \begin{cases} 3x_1 - 2x_2 \leq 0, \\ 2x_1 + 3x_2 \leq 14, \\ x_1 + x_2 \leq 5. \end{cases}$$
17. Построить задачу, двойственную к следующей задаче линейного программирования:
- $$x_1 + 2x_2 + x_3 \rightarrow \max, x_2 \geq 0, \begin{cases} 3x_1 - 4x_2 - x_3 \geq 1, \\ 5x_1 + 6x_2 + x_3 = 2. \end{cases}$$
18. $3x_1 - x_2 + x_3 + 2x_4 \rightarrow \min, x_i \geq 0, \begin{cases} 2x_1 + x_2 +$

В плановый период необходимо получить не менее 1200 тыс. тонн товарного угля и выработать не менее 2500 тыс кВт/ч товарной электроэнергии.

Составить математическую модель задачи оптимизации суммарных затрат на валовой продукт комплекса в плановый период (в денежном эквиваленте), если затраты на 1 тонну добытого угля составляют 0,3 у.е., а на 1 кВт/ч электроэнергии — 0,02 у.е.

21. Решить задачу о коммивояжере с матрицей

$$C = \begin{pmatrix} \infty & 2 & 53 & 11 & 13 & 6 \\ 17 & \infty & 6 & 12 & 32 & 25 \\ 8 & 13 & \infty & 5 & 15 & 11 \\ 21 & 6 & 25 & \infty & 8 &$$

25. Определить оптимальные сроки замены оборудования, чтобы получить максимальную прибыль за 6 лет, если в начале срока установлено новое оборудование. Стоимость нового оборудования $z = 4$ у.е.

возраст оборудования, лет	0	1	2	3	4	5
выпуск продукции, у.е.	12	12	10	9	7	6
затраты на обслуживание, у.е.	1	1	2	3	6	6

Вариант 3

- $xy + \frac{50}{x} + \frac{50}{y} \rightarrow \text{extr.$

11. $f: R^2 \rightarrow R^1$, $f(x_1, x_2) = \max_{t \in [-1, 1]} (t^2 + x_1 t + x_2)$. Является ли f выпуклой на R^2 функцией?
12. $x^2 + xy + y^2 + 3|x + y - 2| \rightarrow \min$.
13. На плоскости даны прямая l и точки A, B , лежащие по разные стороны от нее. Построить окружность, проходящую через данные точки так, чтобы прямая l отсекала на ней хорду наименьшей длины.
14. Имеется три сплава. Первый сплав содержит 20% цинка, 50% олова, 30% марганца. Второй сплав содержит 30% цинка, 20% олова, 50% марганца. Третий сплав содержит 10% цинка, 10% олова, 80% марганца. Требуется приготовить сплав, содержащий 40% олова. Найти минимальный процент цинка в таком сплаве.
15. $2x_1 + 3x_2 - 6x_3 + 8x_4 \rightarrow \min$, $x_i \ge$

20. Строительной организации необходимо выполнить три вида земляных работ (I, II, III) по 25000 м³. Организация располагает для этого тремя экскаваторами A, B, C . Нормы выработки указаны в таблице (м³/ч.)

№ вида работ	A	B	C
I	110	123	71
II	91	86	51
III	91	97	59

Построить математическую модель, определения плана использования экскаваторов по видам работ, при котором все работы выполняются за кратчайшее время.

Примеч

23. Методом ветвей и границ решить задачу целочисленного программирования

$$2x_1 + 4x_2 + x_3 \rightarrow \min, \quad x_j \in Z_+, \quad \begin{cases} 2x_1 - 3x_2 + 2x_3 = 5, \\ -x_1 + x_2 + 3x_3 = 3. \end{cases}$$

24. Методом динамического программирования решить задачу о рюкзаке

$$c = 26, \quad a = (7, 4, 9, 8, 6, 5), \quad b = (2, 12, 3, 7, 1, 3).$$

25. Определить оптимальные сроки замены оборудования, чтобы получить максимальную прибыль за 6 лет, если в начале срока установлено новое

7. Привести пример гладкой конечномерной непериодической экстремальной задачи без ограничений, заданной на всем пространстве, в которой абсолютный максимум и минимум достигаются в бесконечном числе точек.
8. Вычислить $\max_{x \in [0,2]} \min_{y \in [0,2]} (-x^2 + \alpha xy - y^2)$.
9. Внутри данного треугольника найти точку, сумма квадратов расстояний от которой до сторон треугольника была бы наименьшей.
10. $\frac{x^4}{y^4} + \frac{y^4}{x^4} - \frac{x^2}{y^2} - \frac{y^2}{x^2} + \frac{x}{y} + \frac{y}{x} \rightarrow \min, \quad x > 0, y > 0$.
11. $f : R \rightarrow R, f(x) = \inf\{x_1^2 + x_2^2 | x_1 + x_2 = x\}$. Является ли функция f выпуклой на R ?
12. $x^2 + y^2 + 2 \max(x, y) \rightarrow \min$.
13. У грузового автомобиля перед

18. $2x_1 + x_2 - x_3 + 2x_4 \rightarrow \min, x_i \geq 0, \begin{cases} x_1 + 3x_2 - x_3 + 4x_4 \leq 5, \\ -x_1 - x_2 + x_3 + 2x_4 \leq 3. \end{cases}$
19. $\frac{-3x_1 + x_2 + x_3}{x_1 + x_2 + 3x_3} \rightarrow \max, x_i \geq 0, \begin{cases} 2x_1 + x_2 - x_3 = 2, \\ x_1 - x_2 + 2x_3 = 4. \end{cases}$
20. Максимальное количество используемых под овощи площадей в хозяйстве составляет 313 га. Трудовые ресурсы для производства овощей в течение года могут быть выделены в размере 45 000 чел.-дней, в том числе в напряженный период (сентябрь) – 8600 чел.-дней.

По заключенным договорам необходимо продать 50 000 ц. овощей, в том числе капусты (а) – 31 500 ц., огурцов (б) – 4 5

2. Решить транспортную задачу при дополнительных ограничениях:
- а) перевозка $a_1 \rightarrow b_1$ запрещена $x_{11} = 0$;
 б) гарантирована перевозка $a_1 \rightarrow b_2$ в объеме $x_{12} \geq 5$.
23. Методом ветвей и границ решить задачу целочисленного программирования
- $$x_1 - 4x_2 + 3x_3 \rightarrow \min, \quad x_j \in Z_+, \quad \begin{cases} 3x_1 + x_2 - x_3 = 4, \\ -x_1 + 5x_2 + 2x_3 = 23. \end{cases}$$
24. Методом динамического программирования решить задачу о рюкзаке
- $$c = 27, \quad a = (7, 9, 3, 8, 5, 12), \quad b = (2, 4, 3, 7, 1, 3).$$
25. Определить оптимальные сроки замены оборудования, чтобы получить максимальную прибыль за 6 лет, если в начале срока установлено новое оборудование. Стоимость нового оборудования $z =$

7. В эллипс $\frac{x^2}{a^2} + \frac{y^2}{b^2} = 1$ вписать прямоугольник наибольшей площади со сторонами, параллельными осям координат.
8. Вычислить $\max_{x \in [-4, 2]} \min_{y \in [0, 2]} (x^2 + \alpha xy - y^2)$.
9. Медианы AD, BE треугольника ABC взаимно перпендикулярны. Какое максимальное значение может иметь угол C ?
10. $x^3 y^2 z^2 u \rightarrow \max, 2x + xy + z + xyz = 1, x \geq 0, y \geq 0, z \geq 0, u \geq 0$.
11. $x^2 + y^2 + \frac{3}{2}|x + y - 1| \rightarrow \min$.
12. Является ли выпуклым множество

$$\{(x_1, x_2) \mid 0 \leq x_2 \leq \sin x_1^2, x_1 \in [0, \pi]\}?$$
</

17. Построить задачу, двойственную к следующей задаче линейного программирования:

$$x_1 - 2x_2 + x_3 \rightarrow \min, \quad x_2 \geq 0, x_3 \geq 0, \quad \begin{cases} 3x_1 - 4x_2 - x_3 \leq 1, \\ 5x_1 + 6x_2 + x_3 \geq 2. \end{cases}$$

18. $3x_1 - 2x_2 + x_3 + 2x_4 \rightarrow \min, \quad x_i \geq 0, \quad \begin{cases} x_1 - x_2 + 3x_3 + 2x_4 \leq 6, \\ 2x_1 + x_2 - x_3 + 4x_4 \leq 4. \end{cases}$

19. $\frac{4x_1 - x_2 - x_3}{2x_1 + 3x_2 + x_3} \$

21. Решить задачу о коммивояжере с матрицей

$$C = \begin{pmatrix} \infty & 17 & 23 & 16 & 20 & 26 \\ 21 & \infty & 16 & 11 & 30 & 25 \\ 20 & 43 & \infty & 35 & 5 & 11 \\ 21 & 46 & 25 & \infty & 18 & 18 \\ 41 & 16 & 47 & 48 & \infty & 15 \\ 13 & 25 & 5 & 19 & 15 & \infty \end{pmatrix}.$$

22. 1. Методом потенциалов решить транспортную задачу

$$a = (17, 4, 5, 8), \quad b = (3, 12, 2, 17$$

Вариант 6

1. $x^3 - (y - 1)^3 - 3xy^2 \rightarrow \text{extr}.$
2. $xy^2z^3 \rightarrow \text{extr}, x + y + z = 12.$
3. $3x_2^2 - 11x_1 - 3x_2 - x_3 \rightarrow \text{extr}, x_1 - 7x_2 + 3x_3 + 7 \leq 0,$
 $5x_1 + 2x_2 - x_3 \leq 2, x_3 \geq 0.$
4. $\sin x \times \sin y + \sin z \rightarrow \text{extr}, x + y + z = \frac{\pi}{2}, x \geq 0, y \geq 0, z \geq 0.$
5. $y^2 \rightarrow \text{extr}, 3x^3 + 2y^3 - 9xy \leq -4.$
6. Найти расстояние от точки до гиперболы.
7. Привести пример гладкой конечномерной задачи без ограничений, заданной на всем пространстве, в которой функциона

15. $-x_1 - x_2 + x_3 \rightarrow \max, x_i \geq 0, \begin{cases} x_1 + x_2 + x_3 + x_4 = 4, \\ x_1 - 3x_2 + x_3 - x_4 = -2, \\ 2x_1 - 2x_2 + 2x_3 = 2. \end{cases}$
16. При каких значениях параметра k точка $(1, 3)$ является решением задачи
- $$kx_1 + (2 - k)x_2 \rightarrow \max, \begin{cases} 3x_1 - x_2 \leq 0, \\ 2x_1 + 3x_2 \leq 13, \\ x_1 + x_2 \leq 4. \end{cases}$$
17. Построить задачу, двойственную к следующей задаче линейного программирования:
- $$x_1 - 2x_2 - x_3 \rightarrow \min, x_1 \leq 0, x_2 \geq 0, \begin{cases} 3x_1 - 4x_2 - x_3 \leq 1, \\ 5x_1 + 6x_2 + x_3 \geq 2. \end{cases}$$
18. $2x_1 + x_2 + x_3 - 2x_4 \rightarrow \min, x_i \geq 0, \begin{cases} x_1 +$

Корм 1 кг	Цена 1кг, у.е.	корм. ед.	№1	№2	№3
сено клеверное	1,7	0,54	56	9,29	1,95
сено луговое	1,2	0,52	36	6,02	2,14
силос подсолнечный	0,8	0,18	12	3,55	0,65
свекла	1,5	0,12	3	0,38	0,33
картофель	2,4	0,30	9	0,14	0,68
концентраты	4,0	1,06	196	2	

24. Методом динамического программирования решить задачу о рюкзаке

$$c = 25, \quad a = (9, 6, 13, 8, 7, 5), \quad b = (7, 9, 2, 5, 1, 3).$$

25. Определить оптимальные сроки замены оборудования, чтобы получить максимальную прибыль за 6 лет, если в начале срока установлено новое оборудование. Стоимость нового оборудования $z = 5$ у.е.

возраст оборудования, лет	0	1	2	3	4	5
выпуск продукции, у.е.	15	13	11	10	8	8
затраты на обслуживание, у.е.	2	2				

10. Вписать в круговой сектор радиусом R с центральным углом α прямоугольник наибольшей площади.
11. $f : R^2 \rightarrow R$, $f(x_1, x_2) = \max_{t \in [0, 2]} |t^2 + tx_1 + x_2|$. Будет ли f выпуклой на R^2 функцией?
12. $|x| - |y| \rightarrow \text{extr}$, $x^2 + 2x + y^2 - 4y \leq 0$.
13. Малыш может съесть торт за 10 минут, банку варенья — за 13 минут, выпить кастрюлю молока за 14 минут, а Карлсон может сделать это за 6, 6, 7 минут соответственно. За какое наименьшее время они вдвоем смогут покончить с завтраком, состоящим из торта, банки варенья и кастрюли молока?
14. При каком наибольшем значении k для любых трех вещественных неотрицательных чисел a, b, c , сумма которых равна 1, выполняется неравенство

$$19. \frac{2x_1 + 3x_2}{2x_1 + x_2} \rightarrow \max, \quad x_i \geq 0, \quad \begin{cases} 3x_1 + x_2 \geq 8, \\ x_1 - x_2 \leq -3, \\ 2x_1 - x_2 \leq 6. \end{cases}$$

20. На кондитерской фабрике изготавливают три вида восточных сладостей, для которых используется миндаль, фундук и арахис. Миндаль покупается по цене (за тонну) 6 500 у.е., фундук — 2 500 у.е., арахис — 3 500 у.е.

Продукт один должен содержать не менее 50% миндаля и не более 25% фундука, продукт два — не менее 25% миндаля и не более 50% фундука, продукт три может содержать любое количество миндаля, фундука и арахиса. Продажная цена продукта 1 (1 тонна) — 5 000 у.е., продукта 2 — 3 500 у.е., продукта 3 — 2

23. Методом ветвей и границ решить задачу целочисленного программирования

$$3x_2 + 2x_3 \rightarrow \min, \quad x_j \in Z_+, \quad \begin{cases} -x_1 + x_2 + 3x_3 = 5, \\ 2x_1 - x_2 + x_3 = 1. \end{cases}$$

24. Методом динамического программирования решить задачу о рюкзаке

$$c = 26, \quad a = (9, 6, 3, 8, 7, 9), \quad b = (7, 4, 2, 5, 5, 3).$$

25. Определить оптимальные сроки замены оборудования, чтобы получить максимальную прибыль за 6 лет, если в начале срока установлено новое оборудование. Стоимость нового оборудования $z =$

9. Две стороны треугольника ABC равны a, b . Какую наименьшую величину может иметь наибольший угол треугольника?
10. Найти расстояние от точки до конуса $z \geq \sqrt{x^2 + y^2}$.
11. $f : R^2 \rightarrow R$, $f(x_1, x_2) = \max_{t \in [-1, 1]} |t^2 + tx_1 + x_2|$. Будет ли f выпуклой на R^2 функцией?
12. $x_1^2 + 2x_2^2 + \max(x_1, -x_2) \rightarrow \min$, $|2x_1| + |x_2| \leq 4$.
13. Какое из чисел больше:

$$100! \text{ или } 100 \left(\frac{100}{e} \right)^{100}.$$

14. Пусть x_0 – точка локального экстремума функции <

19. $\frac{2x_1 - x_2 + 2x_3}{x_1 + 2x_2 + x_3} \rightarrow \max, x_i \geq 0, \begin{cases} x_1 - 2x_2 + x_3 = 4, \\ x_1 - x_3 = 6. \end{cases}$
20. На производство поступила партия стержней длиной 250 см. и 190 см. Необходимо получить не менее 470 отрезков по 45 см. и не менее 450 отрезков по 80 см. Как разрезать имеющиеся стержни, чтобы сократить до минимума отходы?
21. Решить задачу о коммивояжере с матрицей

$$C = \begin{pmatrix} \infty & 7 & 23 & 6 & 20 & 26 \\ 21 & \infty & 16 & 11 & 30 & 25 \\ 20 & 13 & \infty & 35 & 5 & 11 \\ 21 & 46 & 25 & \infty & 18$$

12. Будет ли выпуклой композиция двух выпуклых функций?
13. Найти наименьшее значение x , для которого существуют y, z такие, что

$$x^2 + 2y^2 + z^2 + xy - xz - yz = 1.$$

14. Дан прямоугольный треугольник, один из острых углов которого равен α . Найти отношение радиусов описанной и вписанной окружностей и определить, при каком α это отношение будет наибольшим.

15. $x_1 + x_2 + x_3 + 3x_4 + x_5 \rightarrow \max, x_i \geq 0,$

$$\begin{cases} x_1 - x_2 + x_3 + x_4 + 4$$

21. Решить задачу о коммивояжере с матрицей

$$C = \begin{pmatrix} \infty & 37 & 23 & 6 & 20 & 26 \\ 21 & \infty & 16 & 11 & 30 & 25 \\ 20 & 13 & \infty & 8 & 5 & 11 \\ 11 & 16 & 25 & \infty & 18 & 18 \\ 41 & 16 & 17 & 8 & \infty & 15 \\ 13 & 25 & 35 & 19 & 15 & \infty \end{pmatrix}.$$

22. 1. Методом потенциалов решить транспортную задачу

$$a = (7, 14, 5, 13), \quad b = (1$$

