

面向21世纪本科生教材

运筹学

及其应用

修订版

朱求长 编著

大学出版社

运筹学及其应用

(修订版)

朱求长 编著

武汉大学出版社

图书在版编目(CIP)数据

运筹学及其应用/朱求长编著. —修订本. —武汉: 武汉大学出版社, 1997. 12

(武汉大学本科生系列教材)

ISBN 7-307-03385-2

I. 运… II. 朱… III. 运筹学 IV. O22

责任编辑: 顾素萍 版式设计: 支 笛

出版发行: 武汉大学出版社 (430072 武昌 珞珈山)

(电子邮件: wdp4@whu.edu.cn 网址: www.wdp.whu.edu.cn)

印刷: 湖北民政印刷厂

开本: 850×1168 1/32 印张: 8.625 字数: 218千字

版次: 1993年8月第1版 1997年12月第2版

2001年11月第3次修订 2002年8月修订版第2次印刷

ISBN 7-307-03385-2/O·248 定价: 14.00元

版权所有, 不得翻印; 凡购买我社的图书, 如有缺页、倒页、脱页等质量问题, 请与当地图书销售部门联系调换。

内 容 提 要

本书根据我国管理类、财经类专业的教学要求,选取了运筹学中线性规划、目标规划、整数规划和网络分析等分支作为本科生运筹学课程的教材。每章末配有习题,书末附有部分习题答案。

本书可作为管理、财经和理工科等方面有关专业的教科书或教学参考书,亦可供广大企业管理和财经部门的管理人员以及工程技术人员阅读和参考。

第二版前言

本书第一版于1993年由武汉大学出版社出版,先后印刷过两次。此次本准备进行第三次印刷,但考虑到自本书第一版问世以来,至今已有四年之久。四年来,各方面的情况都发生了很大的变化,因此有必要对原书进行一些修改和补充,以更好地适应当前教学的需要。

这次的修改主要有以下几处:

1. 考虑到目标规划在管理中的应用日益广泛及学生的接受能力,故专门增加了一章(第五章)来介绍目标规划的概念和方法;
2. 对偶理论和在实际中有重要应用的灵敏度分析部分有较大的加强;
3. 单纯形法的推导部分有所修改,以使其更加清晰易懂。

其他各章也都有一些修改和更正,不再一一列出。

为了教师教学和学生自学的方便,本书各章中的习题已由朱希川同志做出了解答,这本习题解答对于本教材是一个很好的补充和完善。在此,谨向朱希川同志致谢。

最后,再次感谢武汉大学出版社对本书的关心和支持。

朱求长

1997.9

第一版前言

这本书是根据我 1986 年为我校管理学院企业管理等专业编写的一本同名讲义,经过几次修改而成的。其目的是为了满足不同专业类和财经类专业开设运筹学课程的需要。

运筹学是近 50 年来才逐步发展起来的一门新兴科学,最早是由于军事上的需要而产生的。在第二次世界大战前夕,德国的空军已很强大,为了对付德国的空袭,英国防空科学调查委员会主席 H. G. Tizard 组织了一些科学家专门研究如何使用雷达来进行对空作战的问题。科学家们的各种建议构成了一套完整的雷达防空系统,被军方所采用。正因为科学家们的这些工作对作战帮助很大,所以作战研究部主任 A. P. Rowe 称这些工作为“Operational Research”(作战研究,简称为 OR)。到 1942 年,英国的陆、海、空三军都正式建立了 OR 组织,专门研究各种新式武器如何有效地使用的问题。

第二次世界大战结束以后,那些从事作战研究的人员纷纷转入工业生产部门和商业部门。由于经营管理中的许多问题和战争中所碰到的许多问题极为相似,于是,那些 OR 研究人员很快又在经营管理中大显身手,有力促进了英国工业生产的恢复和发展。

美国人称 Operational Research 为 Operations Research,仍简称为 OR。OR 在美国的迅速发展主要还是 20 世纪 50 年代以后的事。由于科学技术的迅猛发展,生产规模越来越大,产品结构越来越复杂,生产的社会化程度也日益提高。要想对这种现代化的大型生产进行科学的组织管理,任何个人都是办不到的,而必须有专

门的人员和机构来进行研究。这种情况就促使许多大型企业都建立了OR组织。另一方面,由于电子计算机的诞生和不断改进,又为OR的实际应用提供了强有力的工具,因为许多大型问题的解决,离开了电子计算机是不可想像的。

OR作为一门独立的学科在我国传播始于20世纪50年代中期。开始,有些同志根据西方20世纪50年代初期对OR一般的理解,将OR译为运用学,后来,中国学者们认为,这门新兴学科的任务,不单是要研究现有武器和设备等的运用,而且更要研究未来武器和设备等的运用,以及将来计划(包括国家计划)的制定,故将OR翻译为运筹学更好。我国从1956年起就开始了运筹学的研究和应用。1958年,粮食运输部门在应用运筹学的过程中,总结出一套“图上作业法”。1965年许多地方又推广应用了统筹法。今天,运筹学在我国的企业管埋、工程技术、运输调度、国民经济计划等方面已得到广泛的应用。

从以上简短介绍中可以看到,运筹学是一门实践性很强、应用性很广的学科。那么,什么是运筹学呢?目前有好几种说法。由于这门学科还很年轻,正在迅速发展之中,所以尚无一致的、确切的定义。其基本含义可以这样表达:运筹学的研究对象是一个系统(如经济系统、作战系统、工作系统等)的组织管理中可以量化的问题;它采用的主要方法是建立数学模型并求解;它要达到的目标是从各种可供选择的方案中找出一个最好的或满意的方案,以实现系统的某一或某些指标整体最优化(例如质量最好,产量最多,工期最短,利润最大,成本最低,或同时要求若干项指标均达到一定的满意度等);它的研究成果是为各级管理(领导)人员在作决策时提供科学的依据。因此,简单地说,运筹学所要研究的就是一个系统的组织管理的优化问题,或说它是一门管理优化技术。正因为如此,国外有些人也称运筹学为管理科学(实际上它只是狭义的管理科学)。

当前,我们国家正在进行伟大的社会主义现代化建设,世界各

国也都在努力发展自己的经济。经济建设需要投入大量的人力、物力和财力等资源,而任何一个国家的资源总是有限的。因此,如何以最少的资源消耗去取得最大的经济效益,便成为各国政府和人民普遍关心的重大问题。从组织管理方面(而不是技术方面)去研究怎样解决这一问题就是管理学的任务,对其中可以量化的问题进行研究和解决,就是运筹学的任务。由此可见,运筹学对于我们最有效地利用各种资源,最大限度地提高一个系统的工作效率,实现管理的科学化、现代化,有着重大的意义。

从整个运筹工作的全过程来看,它包括阐述问题、建立模型、求解、检验、修改、实施六个环节。我们主要介绍如何在经济系统(一个工厂或企业,一个地区或一个国家的经济等)中建立管理问题的数学模型以及对数学模型求解的问题。

关于运筹学方面的著作目前国内外已出版了不少。虽然这些书各有所长,但我们在使用中感到有个共同的问题,就是它们都几乎包含了运筹学的所有分支,内容多。而按照我国管理类和财经类专业现行教学计划的安排,本科生只有一个学期(每周3至4学时)学习运筹学课程。在这么短的时间内,若全面介绍该学科各个分支,势必学而不精,故许多学校实际上都只是讲述了其中的部分内容。鉴于这些考虑,我们编写了这本适合本科生用的运筹学教材。内容包括线性规划、整数(线性)规划和网络分析(包括网络规划和网络计划)三个分支。至于运筹学的其他分支,我们认为,可以另编成书,以适应研究生教学的需要。

为适合管理类和财经类专业的教学要求,本书在编写过程中还特别注意从以下几方面作出努力:

1. 精选题材,学以致用。本书的主要目的在于帮助读者学会运用定量分析技术来解决实际问题,因此对有些运筹学书籍中的过于抽象的部分及理论性太强的部分,本书中省略或修改了,而对实用中极为重要的方法部分则加强了。为使读者了解运筹学的广泛应用和初步掌握建立数学模型的方法,书中列举了大量实例,并

专有一章(第四章)介绍线性规划的应用。对于每个例题的实际背景都给予了尽可能详细的叙述,以增加读者在有关方面的实际知识。

2. 适当加强理论训练。考虑到现代管理(尤其是经济管理)对于数学知识的要求越来越高,各种各样的管理优化问题已大量地、迫切地提到了各级管理人员的面前,因此,加强管理工作者的数学知识训练是重要的。为满足这种需要,本书对优化技术原理部分给出了较系统、完整的阐述。同时,对需要用到的定理,除极少数外,都尽可能地给出了证明,以使读者不仅知其然,而且知其所以然。稍为复杂一点的定理证明通常都放在一章或一节之末尾,初学时可以暂时不看。

3. 适合自学。在整个教学安排中,要求高年级学生更多地进行自学,以更好地培养自己独立学习的能力。为适应此需要,本书对于每种管理优化技术的思想、原理和方法,都写得较为仔细,而且始终遵循由具体到抽象的认识论原则。当然,在要求学生自己动手之处,也设置了某些“障碍”。

本书的编写和出版得到了武汉大学管理学院和经管系领导的积极支持,作者在此谨向他们致谢。这里还要特别感谢武汉大学教务处和武汉大学出版社,正是由于他们的决定性的支持,才使本书得以出版。教材的编写是一个不断发展、不断完善的过程,欢迎广大读者对本书提出宝贵意见。

作者

于武汉大学

1993年4月

目 录

第二版前言	1
第一版前言	1
第一章 线性规划模型和单纯形法	1
§ 1.1 什么是线性规划	3
§ 1.2 求解线性规划问题的基本定理	12
§ 1.3 单纯形法的基本步骤	21
§ 1.4 人工变量法	33
§ 1.5 单纯形法应用的特例	44
§ 1.6 改进单纯形法	51
§ 1.7* 某些定理的证明	56
习题	62
第二章 对偶理论和灵敏度分析	66
§ 2.1 原问题与对偶问题	67
§ 2.2 原始-对偶关系的基本性质	72
§ 2.3 对偶单纯形法	80
§ 2.4 灵敏度分析	83
§ 2.5 对偶变量的经济解释	94
习题	99
第三章 运输问题	102
§ 3.1 运输模型	102

§ 3.2	初始基可行解的求法	107
§ 3.3	最优解的获得	111
§ 3.4	不平衡运输问题	117
§ 3.5	指派问题	119
	习题	125
第四章	线性规划在管理中的应用	128
§ 4.1	生产管理	129
§ 4.2	市场销售	135
§ 4.3	金融与投资	137
§ 4.4	配料选取	141
§ 4.5	任务指派	142
§ 4.6	环境保护	144
	习题	145
第五章	目标规划	149
§ 5.1	目标规划的模型	150
§ 5.2	目标规划的解法	155
	习题	162
第六章	整数规划	164
§ 6.1	整数规划的应用	166
§ 6.2	整数规划的解法	173
	习题	188
第七章	网络规划	191
§ 7.1	图论导引	191
§ 7.2	最小支撑树问题	196
§ 7.3	最短路问题	199

§ 7.4 网络上的最大流问题	208
§ 7.5 最小费用流问题	219
习题.....	223
第八章 网络计划	228
§ 8.1 网络计划的绘制	229
§ 8.2 时间参数的计算	235
§ 8.3 网络计划的调整和优化	240
§ 8.4 非肯定型网络计划	251
习题.....	253
主要参考文献	256
部分习题答案	258

第一章 线性规划模型和单纯形法

线性规划是运筹学的一个最基本的分支,它已成为帮助各级管理人员进行决策的一种十分重要的工具.传统的管理只注重定性分析,已远远不能适应当今社会发展的需要.现代化管理要求采用定性分析和定量分析相结合的方法,一切管理工作要力求做到定量化、最优化,于是就产生了各种各样的管理优化技术.在诸多的管理优化技术中,线性规划是目前最常用而又最为成功的一种.其原因有三:一是应用广泛.管理工作中的大量优化问题可以用线性规划的模型来表达(参见本章第一节的例题及专门介绍线性规划应用的第四章).二是模型较为简单,容易建立,容易学习和掌握.三是求解方法成熟.1947年G. B. Dantzig已对一般的线性规划问题建立了解法,即单纯形法.今天,用单纯形法解线性规划的计算机程序已大量涌现,在计算机上求解此类问题已十分容易.

线性规划在世界上各个工业化国家已经获得了极为广泛的应用,为那些国家的公司、企业节省了成千上万的资金.那么它主要用来解决什么样的问题呢?简单地讲,它的一种最大量、最普遍的应用就是研究有限资源的合理利用问题,或说资源的最优配置问题.一个组织(如一个企业,一个省,甚至一个国家)要进行许多活动(如要生产多种产品),这些活动往往共同涉及使用某些对该组织来说是稀少的、有限的资源.因此该组织的管理部门经常面临这样一个问题:如何将这些资源科学地分配给各项活动,以使整个组

织获得最大的效益?资源分配问题有多种多样的具体形式.为使读者了解线性规划究竟可以用来解决何种管理决策问题,我们在此略举数例:

1) 某工厂可以同时生产数种产品.这些产品的生产都要共同使用设备、原料、运力等若干种资源,而这些资源的供应量受到限制.该厂生产部门的经理面临这样一个问题:应如何制订出最好的生产计划,才能既满足市场需求,又能使本厂获得的利润最高?由于产品的生产是通过资源的转化才得以实现,所以生产的合理安排问题实际上就是一个资源的最优分配问题.

2) 某企业现有一笔资金,准备从许多种股票和证券中选择数种进行投资.该企业财务部门的经理需要研究如何作出最优的投资决策,以便获得最好的经济效益.

3) 某公司在许多地方设有仓库,以便能及时满足用户的需要.现有若干家商场业务员打电话来,要求该公司为他们送去某些商品.公司销售部门的经理需要确定哪个仓库应发多少货给哪家商场,以便使公司支付的总运费最少?(详见例 1.1-2)

4) 某公司计划明年新建 4 座厂房.他们决定采用招标投标办法选择建厂单位.现有 6 个建筑队来投标.该公司需要确定应将哪座厂房分配给哪个队去承建,才能使公司付出的总的建厂费用最少?

其他可用线性规划解决的问题还很多.读者学完本书后可举一反三.在第四章中我们还将专门讲述一些有关的应用.

单纯形法是在计算机上求解大型线性规划问题的一种有效而且可靠的方法,在理论上是一重要成果,但它不是多项式算法.1979年,П. Т. Хатцян 提出了求解 LP 问题(线性规划问题)的多项式算法(称为椭球算法).他证明了 LP 问题是存在多项式算法的.但据计算机上试验结果看,其迭代次数比单纯形法要多,故实用价值并不大.其后,1984年 Narendra Karmarkar 又提出了一种新算法.相对于单纯形法来说,这种新算法的根本作用何在,尚待进一

步检验。

总之,单纯形法仍是我们求解 LP 问题的基本工具,用它来进行优化后分析也非常有效。

下面我们首先引入几个例子,来说明什么是 LP 模型及有关的基本概念,然后在 § 1.2 叙述求解 LP 问题的基本原理。其中部分定理的证明对初学者有一定难度,故放在本章最后一节。基本原理只是给求解 LP 问题指明了道路,提供了理论依据,但并不便直接用来求解具体的 LP 问题。为此在 § 1.3 专门讨论了求解 LP 问题的具体方法,即单纯形法,这一节是本章的重点。在单纯形法的推导中,我们是以已知一个 LP 问题的一个可行基为前提的,在一般情况下,如何寻找第一个可行基呢?解决这一问题便是 § 1.4 的任务。在 § 1.5 讨论了应用单纯形法的几个重要特例之后,接着介绍了效率有所提高的改进单纯形法。

§ 1.1 什么是线性规划

1.1.1 线性规划的简单例子和模型

线性规划是数学规划问题中的一种。以后我们会看到,还有所谓整数规划、非线性规划等。这里的规划(programming)是指计划的意思。在规划前面冠以“线性”二字,则是因为这类规划问题的数学模型是线性的数学表示式。

一个实际问题的数学模型,是依据客观规律,对该问题中我们所关心的那些量进行科学的分析后所得出的反映这些量之间本质联系的数学关系式。但一般说来,我们在工业、农业、交通运输、国防等各方面所遇到的实际问题是很复杂的,它们涉及的因素很多,要想建立包罗各种因素的数学模型,不仅不可能(因有些数量关系无法弄清楚),也没有必要。一个可行的办法是择其主要者,加以讨论之。虽然,一般说来,模型粗一点,它不太精确,而模型细一点,对

实际事物的描述要准确一些,但后者带来的问题是:或者在理论上难以处理,或者在计算时工作量太大,耗费昂贵.所以,应根据实际问题的具体情况,抓住主要矛盾,来建立既能保证精确度要求,又尽量简单的数学模型.

实际的线性规划问题一般都很复杂,为了使读者易于掌握建立线性规划模型的方法,开始我们所选的例子都经过了大大简化.只要弄懂了这些简单的模型,今后遇到较为复杂的问题也就有办法了.

例 1.1-1(饼干生产问题) 葱油饼干和苏打饼干是光华食品厂的两种主要产品.经过对生产过程和现有资源的仔细研究后,该厂生产部门得知,有三种关键性设备,即搅拌机(记为 A_1)、成形机(记为 A_2)和烘箱(记为 A_3),制约着全厂的饼干生产.他们并得到了如下一些技术资料:每生产 1 吨葱油饼干(简记为 I 型饼干)需要 A_1 工作 3 小时, A_2 工作 2 小时, A_3 工作 2 小时,而生产 1 吨苏打饼干(简记为 II 型饼干)的相应时间为 5, 1 和 2 小时.会计部门分析了该厂的各种生产数据,并结合饼干在市场上的销售行情便订出了两种饼干的价格,然后提出每吨 I、II 型饼干可分别使该厂获利 5 百元和 4 百元.根据销售部门提供的信息,目前这两种饼干在市场上都很畅销.但由于各种条件的限制, A_1, A_2, A_3 每天可供利用的工时分别不能超过 15, 5 和 11 小时.这些情况均列入表 1.1 中.现问该厂应制订怎样的生产计划,才能做到充分利用现有资源,使本厂获得最高的利润?

表 1.1

单位时耗/(小时/吨) 资源	产 品		每天现有工时
	I	II	
搅拌机	3	5	15
成形机	2	1	5
烘箱	2	2	11
利润/(百元/吨)	5	4	

解 这里所说的生产计划是指要制订出两种饼干的日产量。显然,可行的生产计划是很多的,比如可以只生产 I 型饼干,也可只生产 II 型饼干,也可两种饼干都生产。通常,一个企业的生产中可以有多种不同的产品组合,而每一种产品组合又有大量的不同的数量组合。每个这样的组合都是一个生产计划。要从这许许多多(有时甚至是无穷多个)生产计划中确定出哪个是最优的(即使企业获利最多的),这是个非常困难的问题,传统的经济分析方法在此无能为力。

现在我们看看线性规划是怎样解决这个问题的。设 x_1, x_2 分别表示 I、II 型饼干每天的生产量,以吨为单位。根据每种饼干对资源的消耗情况和现有的资源数量,我们可得如下的三个不等式:

$$3x_1 + 5x_2 \leq 15, \quad (\text{搅拌机限制})$$

$$2x_1 + x_2 \leq 5, \quad (\text{成形机限制})$$

$$2x_1 + 2x_2 \leq 11. \quad (\text{烘箱限制})$$

另外,根据问题的实际意义可知, x_1, x_2 不能为负数。

用小写英文字母 z 表示每天生产 x_1 吨 I 型饼干和 x_2 吨 II 型饼干所创造的总利润,以百元为单位,则显然有

$$z = 5x_1 + 4x_2.$$

我们的目标是使 z 达到最大值。

现在我们完整地写出这一问题的数学模型:求变量 x_1, x_2 之值,它们满足条件:

$$3x_1 + 5x_2 \leq 15,$$

$$2x_1 + x_2 \leq 5,$$

$$2x_1 + 2x_2 \leq 11,$$

$$x_1, x_2 \geq 0,$$

并使 $z = 5x_1 + 4x_2$ 达到最大值。

今后,为书写上方便,将上述模型记为

$$\max \quad z = 5x_1 + 4x_2, \quad (1.1)$$