

KAPITEL 6 — GANZZAHLIGE OPTIMIERUNG UND VOLLSTÄNDIG UNIMODULARE MATRIZEN

F. VALLENTIN, A. GUNDERT

1. GANZZAHLIGE LINEARE PROGRAMME

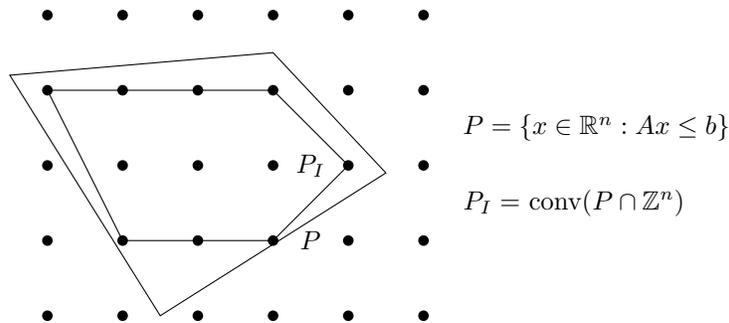
Viele Optimierungsprobleme des Operations Research lassen sich als *ganzzahlige lineare Programme* formulieren.

Definition 1.1. Ein ganzzahliges LP (in Standardform) ist von der Form:

$$\begin{aligned} \max \quad & c^T x \\ & x \in \mathbb{Z}^n \quad (\text{„}x \text{ ganzzahlig“}) \\ & Ax \leq b, \end{aligned}$$

wobei $c \in \mathbb{R}^n$, $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ und $b \in \mathbb{R}^m$. Ein ganzzahliges lineares Programm nennen wir auch *ILP* oder *IP* (= „integer linear program“).

Wir maximieren also eine lineare Funktion über den ganzzahligen Punkten in einem Polyeder.



Beispiel 1.2. Es sei $G = (V, E)$ ein ungerichteter Graph. Mit \mathbb{R}^V bezeichnen wir den Vektorraum der Funktionen von V nach \mathbb{R} , also

$$\begin{aligned} \mathbb{R}^V &= \{f: V \rightarrow \mathbb{R} : f \text{ Funktion}\} \quad \text{und analog} \\ \mathbb{R}^E &= \{f: E \rightarrow \mathbb{R} : f \text{ Funktion}\} \\ \mathbb{R}^{V \times E} &= \{f: V \times E \rightarrow \mathbb{R} : f \text{ Funktion}\} \end{aligned}$$

Wir definieren die Inzidenzmatrix $A \in \mathbb{R}^{V \times E}$ durch

$$A_{v,e} = \begin{cases} 1, & \text{falls } v \in e, \\ 0, & \text{sonst.} \end{cases}$$

Dann

$$\begin{aligned} \nu(G) &= \max\{|M| : M \subseteq E \text{ Matching in } G\} \\ &= \max\left\{\sum_{e \in E} x_e : x_e \geq 0 \forall e \in E, x_e \in \mathbb{Z} \forall e \in E, \sum_{e:v \in e} x_e \leq 1 \forall v \in V\right\} \\ &= \max\left\{\begin{pmatrix} 1 \\ \vdots \\ 1 \end{pmatrix}^T x : x \geq 0, Ax \leq \begin{pmatrix} 1 \\ \vdots \\ 1 \end{pmatrix}, x \in \mathbb{Z}^E\right\} \end{aligned}$$

Wir werden sehen, dass für G bipartit

$$\nu(G) = \max\left\{\begin{pmatrix} 1 \\ \vdots \\ 1 \end{pmatrix}^T x : x \geq 0, Ax \leq \begin{pmatrix} 1 \\ \vdots \\ 1 \end{pmatrix}, x \in \mathbb{R}^E\right\}$$

gilt. Im allgemeinen, nicht-bipartiten Fall kann aber „ $<$ “ gelten.

Zum Beispiel für $G = \text{triangle}$, $x_e = \frac{1}{2} \forall e \in E$.

Dualitätsbeziehung:

Es gilt

$$\begin{aligned} & \max\{c^T x : Ax \leq b, x \in \mathbb{Z}^n\} \\ & \leq \max\{c^T x : Ax \leq b, x \in \mathbb{R}^n\} \\ & = \min\{y^T b : y \geq 0, y^T A = c^T, y \in \mathbb{R}^m\} \\ & \leq \min\{y^T b : y \geq 0, y^T A = c^T, y \in \mathbb{Z}^m\}, \end{aligned}$$

falls (PLP) und (DLP) beide zulässige Lösungen besitzen. Im Allgemeinen gilt „ $<$ “, wie das obige Beispiel zeigt.

Kein Wunder: LP kann *effizient* gelöst werden (in polynomieller Zeit), ILP dagegen *wahrscheinlich nicht* (Äquivalent zum $P \neq NP$ -Problem, für dessen Lösung 1.000.000 Dollar ausgeschrieben sind).

Frage: In welcher Situation gilt „ $=$ “?

Definition 1.3. Ein Polytop $P \subseteq \mathbb{R}^n$ heißt ganzzahlig, falls jede Ecke z von P ganzzahlig ist, das heißt $z \in \mathbb{Z}^n$.

Falls P ganzzahlig ist, dann gilt also

$$\max\{c^T x : x \in P, x \in \mathbb{Z}^n\} = \max\{c^T x : x \in P, x \in \mathbb{R}^n\}$$

Wir suchen also Bedingungen an A und b , damit $P = \{x : Ax \leq b\}$ ganzzahlig ist.

2. VOLLSTÄNDIG-UNIMODULARE MATRIZEN

Definition 2.1. Eine Matrix $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ heißt vollständig-unimodular (VU), falls jeder ihrer Minoren (Determinanten quadratischer Teilmatrizen) gleich 0, -1 oder $+1$ ist. Insbesondere gilt für die Einträge: $A_{ij} \in \{0, -1, +1\}$.

Satz 2.2. Sei $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ VU, $b \in \mathbb{Z}^m$. Dann ist jede Ecke des Polyeders $P = \{x : Ax \leq b\}$ ganzzahlig.

Beweis. Sei z eine Ecke von P . Dann hat die Teilmatrix A_z vollen Rang n und enthält darum eine $n \times n$ Teilmatrix A' mit Rang n . OBdA sei A' in den ersten n Zeilen von A enthalten. Setze $b' = (b_1, \dots, b_n)^T \in \mathbb{Z}^n$, dann gilt $A'z = b'$. Nach der Cramerschen Regel ist $z_i = \frac{\det A'_i}{\det A'}$. Da $|\det A'| = 1$ und A'_i ganzzahlig ist, ist also $z_i \in \mathbb{Z}$. \square

Bemerkung 2.3. Nicht jedes Polyeder hat eine Ecke.

Definition 2.4. Ein Polyeder $P \subseteq \mathbb{R}^n$ heißt ganzzahlig, falls für alle $c \in \mathbb{R}^n$, für die $\max\{c^T x : x \in P\}$ endlich ist, das Maximum an einem ganzzahligen Vektor angenommen wird.

Satz 2.5. Sei $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ VU, $b \in \mathbb{Z}^m$. Dann ist $P = \{x : Ax \leq b\}$ ein ganzzahliges Polyeder.

Beweis. Sei $c \in \mathbb{R}^n$ gegeben und x^* eine optimale Lösung von $\max\{c^T x : Ax \leq b\}$. Wähle $d', d'' \in \mathbb{Z}^n$ mit $d' \leq x^* \leq d''$. Dann ist $Q = \{x \in \mathbb{R}^n : Ax \leq b, d' \leq x \leq d''\}$ ein Polytop. Weiter ist

$$Q = \left\{ x \in \mathbb{R}^n : \begin{bmatrix} A \\ -I \\ I \end{bmatrix} x \leq \begin{pmatrix} b \\ -d' \\ d'' \end{pmatrix} \right\}$$

und die Matrix $\begin{bmatrix} A \\ -I \\ I \end{bmatrix}$ ist VU. Nach dem vorherigen Satz ist Q also ein ganzzahliges

Polytop und außerdem wird $\max\{c^T x : x \in Q\}$ an einer Ecke \tilde{x} angenommen. Da $x^* \in Q$, ist $c^T \tilde{x} \geq c^T x^*$, und weil $A\tilde{x} \leq b$, ist \tilde{x} optimale Lösung von $\max\{c^T x : Ax \leq b\}$. \square

Korollar 2.6. Sei $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ VU, $b \in \mathbb{Z}^m$, $c \in \mathbb{Z}^n$. Dann haben die beiden linearen Programme

$$\max\{c^T x : Ax \leq b\} = \min\{y^T b : y \geq 0, y^T A = c^T\}$$

ganzzahlige Lösungen, falls die Optima endlich sind.

Beweis. Folgt aus dem vorhergehenden Satz, weil die Matrix

$$\begin{bmatrix} -I \\ A^T \\ -A^T \end{bmatrix} \in \mathbb{Z}^{(2n+m) \times m} \text{ VU ist.}$$

\square

Ziel: Charakterisierung von vollständig-unimodularen Matrizen mit Hilfe von Ganzzahligkeit von Polyedern.

Satz 2.7. (Hoffman, Kruskal 1956)

Sei $A \in \mathbb{Z}^{m \times n}$. Dann gilt

A ist VU \Leftrightarrow für alle $b \in \mathbb{Z}^m$ ist $P = \{x : Ax \leq b, x \geq 0\}$ ganzzahlig.

Beweis.

„ \Rightarrow “: Weil $P \subseteq \{x : x \geq 0\}$, wird $\max\{c^T x : x \in P\}$ in einer Ecke von P angenommen, falls das Maximum endlich ist (\rightarrow Aufgabe 9.1). Sei z eine Ecke von P . Definiere $B = \begin{bmatrix} A \\ -I \end{bmatrix}$. Betrachte

$$Bx = \begin{bmatrix} A \\ -I \end{bmatrix} x \leq \begin{pmatrix} b \\ 0 \end{pmatrix}.$$

Dann enthält Bz eine reguläre Teilmatrix $B' \in \mathbb{Z}^{n \times n}$. Sei $b' \in \mathbb{Z}^n$ der entsprechende Teilvektor von $\begin{pmatrix} b \\ 0 \end{pmatrix}$. Dann ist $z = (B')^{-1}b'$ ganzzahlig aufgrund der Cramerschen Regel und weil A VU ist.

„ \Leftarrow “: Sei A' eine reguläre $k \times k$ -Teilmatrix von A . Zu zeigen: $|\det A'| = 1$.
 OBdA sei A' die obere linke Teilmatrix von A . Betrachte $B \in \mathbb{Z}^{m \times m}$ bestehend aus den ersten k und den letzten $m - k$ Spalten von $[A \ I_m]$, also

$$[A \ I_m] = \left[\begin{array}{c|c} A' & 0 \\ \hline 0 & I_{m-k} \end{array} \right] \text{ und } B = \left[\begin{array}{c|c} A' & 0 \\ \hline 0 & I_{m-k} \end{array} \right]$$

Dann ist $|\det B| = |\det A'|$.

Ziel: Zeige $B^{-1} \in \mathbb{Z}^{m \times m}$.

Denn: Weil dann $\det B^{-1} \in \mathbb{Z}$ und $\det B \cdot \det B^{-1} = 1$, muss $|\det B| = 1$ sein.

Sei $i \in \{1, \dots, m\}$. Wir zeigen, dass die i -te Spalte von B^{-1} ganzzahlig ist: Wähle $y \in \mathbb{Z}^m$ mit $y + B^{-1}e_i \geq 0$ und setze $z = y + B^{-1}e_i$. Dann ist $Bz = By + e_i \in \mathbb{Z}^m$. Setze $b = Bz$. Füge in z hinter den ersten k Komponenten $n - k + k$ Nullen ein und nenne diesen Vektor z' . Dann gilt nach Konstruktion

$$[A \ I]z' = Bz = b.$$

Da $z' \geq 0$, liegt der Vektor z'' , der aus den ersten n Komponenten von z' besteht, in $P = \{x : Ax \leq b, x \geq 0\}$. Das heißt es gilt

$$\begin{bmatrix} A \\ -I \end{bmatrix} z'' \leq \begin{pmatrix} b \\ 0 \end{pmatrix}.$$

Die ersten k und die letzten $n - k$ dieser Ungleichungen sind mit Gleichheit erfüllt. Da die entsprechenden Zeilen von $\begin{bmatrix} A \\ -I \end{bmatrix}$ linear unabhängig sind, ist also z'' eine Ecke von P . Nach Voraussetzung ist $z'' \in \mathbb{Z}^n$. Auf den ersten n Komponenten stimmen z' und z'' überein. Die letzten m Komponenten von z' sind durch $b - Az''$ gegeben und also auch ganzzahlig. Also ist $z \in \mathbb{Z}^m$ und somit auch $B^{-1}e_i = z - y \in \mathbb{Z}^m$. □

3. VOLLSTÄNDIG-UNIMODULARE MATRIZEN UND BIPARTITE GRAPHEN

Satz 3.1. Sei $G = (V, E)$ ein ungerichteter Graph. Dann gilt
 G ist bipartit \Leftrightarrow Die Inzidenzmatrix $A \in \mathbb{R}^{V \times E}$ ist VU.

Beweis.

„ \Rightarrow “: Sei B eine $t \times t$ Teilmatrix von A .

Zeige: $\det B \in \{-1, 0, +1\}$ per Induktion nach t .

$t = 1$: \checkmark

$t > 1$:

1. Fall: B enthält eine Nullspalte. Dann ist $\det B = 0$.
2. Fall: B enthält eine Spalte, die genau eine 1 enthält. Dann ist B (nach eventueller Permutation von Zeilen und Spalten) von der Form

$$B = \begin{bmatrix} 1 & b^T \\ 0 & B' \end{bmatrix}, \quad b \in \mathbb{R}^{t-1}, \quad B' \in \mathbb{R}^{(t-1) \times (t-1)}.$$

Nach Induktionsvoraussetzung ist $\det B' \in \{-1, 0, +1\}$. Also auch $\det B \in \{-1, 0, +1\}$.

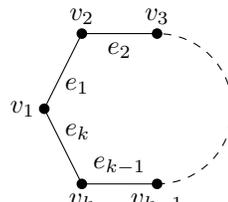
3. Fall: Jede Spalte von B enthält genau zwei Einsen. Da G bipartit ist, kann man (nach eventueller Permutation der Zeilen) B als

$$B = \begin{bmatrix} B' \\ B'' \end{bmatrix}$$

schreiben, wobei jede Spalte von B' genau eine 1 enthält und jede Spalte von B'' genau eine 1 enthält. Aufaddieren aller Zeilen von B' ergibt den Vektor $(1, \dots, 1)$. Genauso wie Aufaddieren aller Zeilen von B'' . Das heißt die Zeilen von B sind linear abhängig, also $\det B = 0$.

„ \Leftarrow “: Sei A VU. Angenommen G ist nicht bipartit. Dann enthält G einen Kreis ungerader Länge mit Knoten v_1, \dots, v_k und Kanten e_1, \dots, e_k . Die entsprechende Teilmatrix von A (mit Zeilen v_1, \dots, v_k und Spalten e_1, \dots, e_k) ist von der Form:

	e_1	e_2	e_3	\dots	e_{k-1}	e_k
v_1	1	0	0	\dots	0	1
v_2	1	1	0	\dots	0	0
v_3	0	1	1	\dots	0	0
\vdots	\vdots	\vdots	\vdots	\ddots	\vdots	\vdots
v_{k-1}	0	0	0	\dots	1	0
v_k	0	0	0	\dots	1	1



Zum Beispiel durch Entwicklung nach der k -ten Spalte sieht man, dass die Determinante dieser Matrix gleich $(+1) \cdot 1 + (+1) \cdot 1 = 2$ ist (k ist ungerade!). Also kann A nicht VU sein. □

Korollar 3.2. (*Matching-Theorem von König; siehe Kapitel 3.3*)

Sei $G = (V, E)$ ein bipartiter Graph. Dann

$$\begin{aligned} \nu(G) &= \max\{|M| : M \subseteq E \text{ Matching in } G\} \\ &= \min\{|U| : U \subseteq V \text{ Knotenüberdeckung in } G\} \\ &= \tau(G). \end{aligned}$$

Beweis.

$$\begin{aligned}
\nu(G) &= \max\left\{\sum_{e \in E} x_e : x_e \geq 0 \forall e \in E, x_e \in \mathbb{Z}, \sum_{e: v \in e} x_e \leq 1 \forall v \in V\right\} \\
&= \max\{1^T x : x \in \mathbb{Z}^E, x \geq 0, Ax \leq 1\} \\
&= \max\{1^T x : x \in \mathbb{R}^E, x \geq 0, Ax \leq 1\} \quad (\text{nach Hoffman-Kruskal, weil } A \text{ VU ist}) \\
&= \min\{1^T y : y \in \mathbb{R}^V, y \geq 0, y^T A \geq 1\} \quad (\text{LP Dualitat}) \\
&= \min\{1^T y : y \in \mathbb{Z}^V, y \geq 0, y^T A \geq 1\} \quad (\text{Hoffman-Kruskal}) \\
&= \min\left\{\sum_{v \in V} y_v : y_v \in \mathbb{Z}, y_v \geq 0 \forall v \in V, y_u + y_v \geq 1 \forall \{u, v\} \in E\right\} \\
&= \tau(G).
\end{aligned}$$

Ein Vektor $y \in \mathbb{Z}^V$, der das Minimum erzielt, hat nur 0/1- Komponenten. Hierbei ist $y_v = 1 \Leftrightarrow v$ ist Knoten in einer minimalen Knotenuberdeckung. \square

Korollar 3.3. Sei $G = (V, E)$ ein bipartiter Graph. Dann

$$\text{conv}\{\chi^M : M \subseteq E \text{ Matching in } G\} = \{x \in \mathbb{R}^E : x \geq 0, Ax \leq 1\},$$

wobei A die Inzidenzmatrix von G ist.

Beweis.

„ \subseteq “: \checkmark

„ \supseteq “: $Q = \{x \in \mathbb{R}^E : x \geq 0, Ax \leq 1\}$ ist beschrankt, also ein Polytop und somit ist Q die konvexe Hulle seiner Ecken. Da A VU ist, sind alle Ecken von Q ganzzahlig. Und jeder ganzzahlige Vektor in Q ist Inzidenzvektor eines Matchings in G . \square

Korollar 3.4. (Theorem von Egavary (1931))

Sei $G = (V, E)$ ein bipartiter Graph und $w : E \rightarrow \mathbb{Z}$ eine Gewichtsfunktion. Dann ist

$$\begin{aligned}
\nu_W(G) &= \max\{w(M) : M \subseteq E \text{ Matching in } G\} \\
&= \min\left\{\sum_{v \in V} y_v : y \in \mathbb{Z}^V, y \geq 0, y_u + y_v \geq w(\{u, v\}) \forall \{u, v\} \in E\right\}.
\end{aligned}$$

Beweis. Weil die Inzidenzmatrix $A \in \mathbb{R}^{V \times E}$ von G VU ist, gilt

$$\max\{w^T x : x \geq 0, Ax \leq 1\} = \min\{1^T y : y \geq 0, y^T A \geq w\},$$

wobei beide Probleme optimale ganzzahlige Losungen haben. \square

4. VOLLSTANDIG-UNIMODULARE MATRIZEN UND GERICHTETE GRAPHEN

Definition 4.1. Die Inzidenzmatrix eines gerichteten Graphen $D = (V, A)$ ist $M \in \mathbb{R}^{V \times A}$ mit

$$M_{v,a} = \begin{cases} +1, & \text{falls } a \in \delta^-(v) \quad \xrightarrow{a} \bullet v \\ -1, & \text{falls } a \in \delta^+(v) \quad v \bullet \xrightarrow{a} \\ 0, & \text{sonst.} \end{cases}$$

Jede Spalte von M enthält genau eine $+1$ und genau eine -1 .

Satz 4.2. M ist VU.

Beweis. Sei $B \in \mathbb{R}^{t \times t}$ eine Teilmatrix von M . Zeige per Induktion nach t , dass $\det B \in \{-1, 0, +1\}$.

$t = 1$: ✓

$t > 1$:

1.Fall: B hat eine Nullspalte $\Rightarrow \det B = 0$.

2.Fall: B hat eine Spalte, die genau einen Eintrag $\neq 0$ enthält.
Dann, nach eventueller Vertauschung von Zeilen und Spalten, ist

$$B = \begin{bmatrix} \pm 1 & b^T \\ 0 & B' \end{bmatrix}, \quad b \in \mathbb{R}^{t-1}, \quad B' \in \mathbb{R}^{(t-1) \times (t-1)}.$$

Nach Induktionsvoraussetzung ist $\det B' \in \{-1, 0, +1\}$,
also $\det B = (\pm 1) \cdot \det B' \in \{-1, 0, +1\}$.

3.Fall: Jede Spalte von B enthält zwei Einträge $\neq 0$. Aufaddieren sämtlicher Zeilen von B ergibt 0, das heißt $\det B = 0$.

□

Korollar 4.3. (*Max-flow-min-cut Theorem*)

Sei $D = (V, A)$ ein gerichteter Graph, $s, t \in V$ und $c: A \rightarrow \mathbb{R}_{\geq 0}$ eine Kapazitätsfunktion. Dann

$$\begin{array}{l} \max \text{value}(f) \\ f \text{ ist } s\text{-}t\text{-Fluss} \\ 0 \leq f \leq c \end{array} = \begin{array}{l} \min c(\delta^+(U)) \\ U \subseteq V \\ s \in U, t \notin U. \end{array}$$

Beweis.

$\max \leq \min$: ✓

$\max \geq \min$: Sei $M \in \mathbb{R}^{V \times A}$ die Inzidenzmatrix von D und sei M' die Matrix, die man durch Streichen der zu s und t gehörenden Zeilen aus M bekommt. Dann gilt

$$f \in \mathbb{R}^A \text{ ist } s\text{-}t\text{-Fluss} \Leftrightarrow M'f = 0.$$

Sei $w^T \in \mathbb{R}^A$ die zu t gehörende Zeile von M . Dann ist

$$\text{value}(f) = w^T f.$$

Also

$$\max \text{value}(f) = \max\{w^T f : 0 \leq f \leq c, M'f = 0\}$$

f ist s - t -Fluss

$$0 \leq f \leq c$$

$$\stackrel{(1)}{=} \min\{y^T c : y \geq 0, z \in \mathbb{R}^{V \setminus \{s, t\}}, y^T + z^T M' \geq w^T\}$$

$$= \min\{y^T c : (y^T \ z^T) \begin{bmatrix} I & I \\ 0 & M' \end{bmatrix} \geq (0 \ w^T)\},$$

wobei (1) nach LP Dualität gilt. Die Matrix $\begin{bmatrix} I & I \\ 0 & M' \end{bmatrix}$ ist VU und der Vektor $(0 \ w^T)$ ist ganzzahlig, also wird das Maximum an ganzzahligen Vektoren y^* , z^* angenommen. Erweitern wir z^* zu $z^{**} \in \mathbb{Z}^V$ durch $z_t^{**} = -1$ und $z_s^{**} = 0$ und $z_v^{**} = z_v^* \ \forall v \in V \setminus \{s, t\}$, so gilt $(y^*)^T + (z^{**})^T M \geq 0$, denn

$$\begin{aligned} [(y^*)^T + (z^{**})^T M]_a &= \underbrace{y_a^* + [(z^*)^T M']_a}_{\geq w_a} + \underbrace{z_s^{**}}_{=0} \cdot M_{s,a} + \underbrace{z_t^{**}}_{=-1} \cdot M_{t,a} \\ &\geq w_a + (-1) \cdot \underbrace{M_{t,a}}_{=w_a} = 0. \end{aligned}$$

Setze $U = \{v \in V : z_v^{**} \geq 0\}$. Dann ist $s \in U$, $t \notin U$.

Behauptung: $\sum_{a \in \delta^+(U)} c(a) \leq (y^*)^T c$ (= max value(f)).

Beweis: Es genügt zu zeigen, dass falls $a \in \delta^+(U)$, dann $y_a^* \geq 1$. Da $z^{**} \in \mathbb{Z}^V$, gilt für $a = (u, v) \in \delta^+(U)$:

$$z_u^{**} \geq 0, \quad z_v^{**} \leq -1 \text{ nach Definition von } U.$$

Wegen $[(y^*)^T + (z^{**})^T M]_a \geq 0$ gilt

$$\begin{aligned} y_a^* + z_v^{**} - z_u^{**} &\geq 0, \text{ das heißt} \\ y_a^* &\geq z_u^{**} - z_v^{**} \geq 1. \end{aligned}$$

□