

1. Übungsblatt - Dynamische Optimierung

1. Betrachten Sie das in der Vorlesung eingeführte endlich-stufige deterministische dynamische Optimierungsproblem $(N, \mathcal{S}, \mathcal{A}, r_n, z_n, V_N)$ mit Planungshorizont N , Zustandsraum \mathcal{S} (abzählbar und nicht-leer), Menge $S_n \subseteq \mathcal{S}$ der Zustände in der Stufe n , Aktionenraum \mathcal{A} (endlich und nicht-leer), Menge $A_n(s_n)$ der zulässigen Aktionen in Stufe n und Zustand s_n , einstufige Gewinnfunktion $r_n(s_n, a_n)$ in Stufe n und Zustand s_n bei Aktion $a_n \in A_n(s_n)$, Stufenfunktionstransformation z_n , die jedem Paar (s_n, a_n) mit $s_n \in S_n$ und $a_n \in A_n(s_n)$ den nachfolgenden Zustand $s_{n+1} := z_n(s_n, a_n) \in S_{n+1}$ zuordnet, sowie terminale Gewinnfunktion $V_N(S_N)$, die vom Zustand s_N der letzten Stufe abhängt.

Beachten Sie, dass in dieser Problemstellung der Zustand s_{n+1} in der Stufe $n + 1$ nur von der Aktion a_n und dem Zustand s_n in der Stufe n abhängt. Daher wird dieses Problem auch dynamisches Optimierungsproblem *erster Ordnung* genannt.

Betrachten Sie nun ein ähnliches dynamisches Optimierungsproblem in dem der Zustand s_{n+1} in der Stufe $n + 1$ auch vom Zustand s_{n-1} in der Stufe $n - 1$ abhängt (ein dynamisches Optimierungsproblem *zweiter Ordnung*). Zeigen Sie, dass ein dynamisches Optimierungsproblem zweiter Ordnung mit Hilfe von modifizierten Zustandsvariablen als dynamisches Optimierungsproblem erster Ordnung formuliert werden kann.

2. Angenommen, der Bedarf r_i , $1 \leq i \leq 5$, eines Bauteiles ist für die nächsten fünf Monate folgendermaßen gegeben: $r_1 = 2$, $r_2 = 4$, $r_3 = 2$, $r_4 = 2$ und $r_5 = 4$. Die Bauteile müssen produziert werden; die Rüstkosten betragen 5 Euro, die Produktionskosten 1 Euro pro Stück und die Lagerkosten 0,30 Euro pro Stück und Monat. Es wird weiters angenommen, dass die gesamte Produktion eines Monats zum Monatsbeginn getätigt wird und, dass der Bedarf eines Monats jedesmals zum Monatsbeginn und eventuell unmittelbar nach der Produktion, ohne zeitliche Verzögerung, den Kunden geliefert wird. Ermitteln Sie mit Hilfe eines dynamischen Optimierungsverfahrens den kostenminimalen Produktionsplan, der den monatlichen Bedarf erfüllt.
3. Ein Taxi-Unternehmen verbraucht pro Monat 8500 Liter Benzin. Der Verbrauch erfolgt kontinuierlich mit konstanter Verbrauchsrate. Die Benzinkosten betragen 1,20 Euro pro Liter, mit fixen Bezugskosten von 1000 Euro. Die Lagerungskosten belaufen sich auf 1 Cent pro Liter und Monat. Bestimmen Sie wie oft eine Bestellung aufgegeben und welche Menge bestellt werden sollte, wenn keine Fehlmengen erlaubt sind und die Gesamtkosten minimiert werden sollten.
4. Die Verkaufschefin eines Verlages für akademische Lehrbücher hat 6 Verkäufer im Außendienst beschäftigt, die drei verschiedene Regionen des Landes betreuen sollen. Sie hat beschlossen, dass jede Region mindestens einen Verkäufer zugewiesen bekommt, und dass jeder einzelne Verkäufer nur eine Region betreuen soll. Sie will nun bestimmen, wieviele Verkäufer den jeweiligen Regionen zugeteilt werden sollen, damit der Umsatz maximiert wird. Tabelle 1 gibt für jede Region den geschätzten Zuwachs des Umsatzes an (in geeigneten Einheiten), wenn eine unterschiedliche Anzahl von Verkäufern dort tätig ist. Lösen Sie dieses Problem mit Hilfe der dynamischen Optimierung.

Anzahl der Verkäufer	Region		
	1	2	3
1	4	3	5
2	6	6	7
3	9	8	10
4	11	10	12

Tabelle 1: Daten für Beispiel 4

5. Damit das Weltraumprojekt eines Staates erfolgreich ist und die Menschheit sicher zum Mars fliegen kann, muss ein bestimmtes technisches Problem gelöst werden. Drei Forschungsteams sind derzeit damit beschäftigt, drei verschiedene Lösungsmethoden für dieses Problem zu untersuchen. Unter den gegenwärtigen Umständen schätzt man, dass die jeweiligen Teams - im weiteren Verlauf mit 1, 2 und 3 bezeichnet - mit einer Wahrscheinlichkeit von 0.4, 0.6 bzw. 0.8 ohne Erfolg bleiben. Da das Ziel darin besteht, die Wahrscheinlichkeit für ein Scheitern von allen drei Teams zu minimieren, wurden zwei weitere Spitzenwissenschaftler für das Projekt eingestellt. Tabelle 2 gibt die geschätzte Wahrscheinlichkeit dafür an, dass die jeweiligen Teams erfolglos sind, wenn die Teams um 0, 1 oder 2 Wissenschaftler erweitert werden. Das Problem besteht darin, zu bestimmen, wie die zwei zusätzlichen Wissenschaftler eingesetzt werden sollen, um die Wahrscheinlichkeit eines Fehlschlages aller drei Teams zu minimieren. Lösen Sie dieses Problem mit Hilfe der dynamischen Optimierung.

Anzahl der neuen Wissenschaftler	Wahrscheinlichkeit für einen Fehlschlag		
	Team		
	1	2	3
0	0.4	0.6	0.8
1	0.2	0.4	0.5
2	0.15	0.2	0.3

Tabelle 2: Daten für Beispiel 8

6. Die Arbeitsbelastung in einem örtlichen Geschäftsbetrieb ist abhängig von großen saisonalen Schwankungen. Da es schwierig ist die Arbeiter zu entlassen und da die Kosten für die Ausbildung hoch sind, widerstrebt es dem Geschäftsführer, Arbeiter in den ruhigen Jahreszeiten zu entlassen. Es widerstrebt ihm gleichermaßen, die Lohnsumme von den Spitzenzeiten beizubehalten, wenn es nicht notwendig ist. Er ist grundsätzlich dagegen, regelmäßig Überstunden leisten zu lassen. Da die gesamte Arbeit auftragsabhängig durchgeführt wird, ist es nicht möglich in den ruhigen Zeiten Läger zu bilden. Der Geschäftsführer steht deshalb in dem Dilemma, welche Politik er bei der Festlegung der Beschäftigungsniveaus einschlagen soll. Es werden folgende Schätzungen des Bedarfs an Arbeitskräften in den vier Jahreszeiten für die nächste Zeit angegeben:

Jahreszeit	Frühling	Sommer	Herbst	Winter	Frühling
Bedarf in Personen	255	270	240	200	255

Die Beschäftigung darf nie unter dieses Niveau sinken. Jede Beschäftigung über diesem Niveau führt zu überflüssigen Kosten von ca. 2000 Euro pro Person und Jahreszeit. Es wird geschätzt, dass die Kosten der Ein- und Ausstellung so aussehen, dass sich die gesamten Kosten einer Änderung des Beschäftigungsniveaus von einer Saison zur nächsten aus der quadrierten Differenz zwischen den Beschäftigungsniveaus multipliziert mit 130 Euro ergeben. Da auch Teilzeitkräfte eingestellt werden können, können auch nichtganzzahlige Beschäftigungsniveaus vorkommen und auch die Kostendaten können sich als gebrochene Zahlen ergeben.

Der Geschäftsführer muß bestimmen, welche Beschäftigungsniveaus in jeder Saison einzuhalten sind, damit die gesamten überflüssigen Kosten minimiert werden. Lösen Sie dieses Problem mit Hilfe der dynamischen Optimierung.

7. Formulieren und lösen Sie das untenstehende Problem als dynamisches Optimierungsproblem:

$$\begin{aligned} \max \quad & 3x_1 + 7x_2 + 6f(x_3) \\ \text{u.d.NB.} \end{aligned}$$

$$x_1 + 3x_2 + 2x_3 \leq 6$$

$$x_1 + x_2 \leq 5$$

$$x_1, x_2, x_3 \geq 0$$

wobei $f: [0, +\infty) \rightarrow \mathbb{R}$ folgendermaßen gegeben wird:

$$f(x) = \begin{cases} 0 & x = 0 \\ -1 + x_3 & x > 0 \end{cases}$$

8. Zu betrachten ist das folgende ganzzahlige nichtlineare Optimierungsproblem

$$\begin{array}{ll} \max & z = x_1 x_2^2 x_3^3 \\ \text{udNB} & \\ & x_1 + 2x_2 + 3x_3 \leq 10 \\ & x_1 \geq 1, x_2 \geq 1, x_3 \geq 1 \\ & x_1, x_2, x_3 \text{ ganzzahlig} \end{array}$$

Lösen Sie dieses Problem mit Hilfe der dynamischen Optimierung.