

в отличие от [4, 7, 8] рассмотрим неявную разностную схему

$$Y_t = \varphi(x, t, \hat{Y}, \hat{Y}_x) \quad (16)$$

с начальными и граничными условиями типа (1), (3). Решение системы нелинейных уравнений (16) будем находить, используя метод Ньютона, который сводит систему (16) к линеаризованной

$$\hat{y}_i^{(s+1)} = \sum_{l=1}^n \frac{\partial \varphi^k}{\partial y^l} \left(\hat{y}^{(s+1)} - \hat{y}^{(s)} \right) + \sum_{l=1}^n \frac{\partial \varphi^k}{\partial y_x^l} \left(\hat{y}_x^{(s+1)} - \hat{y}_x^{(s)} \right) + \varphi^k, k=1, 2, \dots, n. \quad (17)$$

Теорема 3. Пусть разностная схема (16) аппроксимирует исходную систему (15) с погрешностью $O(\tau+h^2)$ и компоненты вектора φ являются функциями достаточно гладкими. Тогда при $h, \tau \rightarrow 0$ и таких, что $\tau=h^\alpha$, $1 < \alpha < 3$, решение, получаемое из системы (17), сходится к решению исходной задачи, при этом скорость сходимости совпадает по порядку с погрешностью аппроксимации.

ЛИТЕРАТУРА

1. Рождественский Б. Л., Яненко Н. Н. Системы квазилинейных уравнений.— М., 1978.
2. Годунов С. К. Уравнения математической физики.— М., 1971.
3. Самарский А. А., Попов Ю. П. Разностные методы решения задач газовой динамики.— М., 1980.
4. Вакульчик П. А.— Вестн. Белорусского ун-та. Сер. 1, физ., мат. и мех., 1982, № 2, с. 41.
5. Самарский А. А. Теория разностных схем.— М., 1977.
6. Андреев В. Б.— Ж. выч. мат. и мат. физ., 1968, т. 8, № 6, с. 1218.
7. Абрашн В. Н.— Дифференц. уравнения, 1975, т. 11, № 2, с. 294.
8. Абрашн В. Н.— Вестн АН БССР. Сер. физ.-мат. наук, 1977, № 4, с. 13.
9. Вакульчик П. А.— В сб.: Актуальные проблемы общественных и естественных наук. Минск, 1981, с. 52.

Поступила в редакцию
29.05.82

Кафедра вычислительной математики

УДК 62-50

Л. А. ПИЛИПЧУК

АЛГОРИТМ РЕШЕНИЯ ДВУХПРОДУКТОВОЙ ТРАНСПОРТНОЙ ЗАДАЧИ С ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ МАТРИЦЕЙ ОГРАНИЧЕНИЙ ПРЯМЫМ МЕТОДОМ

Рассмотрим сетевую двухпродуктовую транспортную задачу с дополнительными ограничениями:

$$\sum_{k=1}^2 \sum_{(i,j) \in U} c_{ij}^k x_{ij}^k \rightarrow \min, \quad (1)$$

$$\sum_{i \in I_i^+(U)} x_{ij}^k - \sum_{i \in I_i^-(U)} x_{ij}^k = a_i^k, \quad i \in I, \quad (2)$$

$$x_{ij}^k \geq 0, \quad x_{ij}^1 + x_{ij}^2 \leq d_{ij}, \quad (i, j) \in U, \quad k=1, 2, \quad (3)$$

$$\sum_{k=1}^2 \sum_{(i,j) \in M_p} \lambda_{ij}^{kp} x_{ij}^k = \alpha_p, \quad p = \overline{1, l}, \quad (4)$$

где I, U — множества узлов и дуг сети S ; $c_{ij}^k, a_i^k, d_{ij}, \alpha_p, \lambda_{ij}^{kp}$ — заданные числа; $M_p \subset U$ — заданные множества, $I_i^+(U) = \{j : (i, j) \in U\}$, $I_i^-(U) = \{j : (j, i) \in U\}$.

В данной работе строится алгоритм решения задачи (1)–(4), которая отличается от [1] наличием коэффициентов λ_{ij}^{kp} , $k=1, 2, p=\overline{1, l}$, $(i, j) \in M_p, M_p \subset U$, где λ_{ij}^{kp} — произвольные действительные числа.

Опорой сети будем называть совокупность дуг $U_{оп} = \{U_{оп}^1, U_{оп}^2, U^*\}$,

такую, что $U_{\text{он}}^k \subset U^k$, $k = 1, 2$; $U^* \subset U_{\text{он}}^1 \cap U_{\text{он}}^2 = \{(i, j) : (i, j)^1 \in U_{\text{он}}^1, (i, j)^2 \in U_{\text{он}}^2\}$, $U = U^1 \cup U^2$, $I(U_{\text{он}}^k) = \{(i, j)^k \in U_{\text{он}}^k, k = 1, 2\}$, и система

$$\begin{aligned} \sum_{i \in I_{\overline{1}}^+(U_{\text{он}}^1)} x_{ij}^1 - \sum_{i \in I_{\overline{1}}^-(U_{\text{он}}^1)} x_{ji}^1 &= 0, \quad i \in I(U_{\text{он}}^1), \\ x_{ij}^1 + x_{ij}^2 &= 0, \quad (i, j) \in U^*, \\ \sum_{k=1}^2 \sum_{(i, j) \in M_{p_i}} \lambda_{ij}^{kp} x_{ij}^k &= 0, \quad p = \overline{1, l}, \quad k = 1, 2 \end{aligned} \quad (5)$$

имеет только тривиальное решение для $M_{p_i} = M_p \cap (U_{\text{он}}^1 \cup U_{\text{он}}^2)$ и нетривиальное для каждой из следующих совокупностей:

- 1) $\{U_{\text{он}}^k, k = 1, 2, U^* \setminus (i, j)\}$, где (i, j) — любая дуга из U^* ;
- 2) $\{U_{\text{он}}^1 \cup (i, j), U_{\text{он}}^2, U^*\}$, где $(i, j)^1$ — любая дуга из $U^1 \setminus U_{\text{он}}^1$;
- 3) $\{U_{\text{он}}^1, U_{\text{он}}^2 \cup (i, j)^2, U^*\}$, где $(i, j)^2$ — любая дуга из $U^2 \setminus U_{\text{он}}^2$;

Пара $\{x, U_{\text{он}}\}$ из потока и опоры — опорный поток. Дуги $(i, j)^k \in U_{\text{он}}^k$, $k = 1, 2$ назовем опорными, остальные — неопорными. Опорный поток назовем невырожденным, если опорные дуговые потоки удовлетворяют следующим неравенствам; $x_{ij}^k > 0$, $(i, j)^k \in U_{\text{он}}^k$, $k = 1, 2$; $x_{ij}^1 + x_{ij}^2 < d_{ij}$, для $(i, j)^1 \in (U_{\text{он}}^1 \cup U_{\text{он}}^2) \setminus U^*$ или $(i, j)^2 \in (U_{\text{он}}^1 \cup U_{\text{он}}^2) \setminus U^*$.

Рассмотрим некоторый цикл L_q в сети $S: (i_1^q, i_2^q, \dots, i_r^q)$. Выбрав в нем направление движения, обозначим через L_q^+ и L_q^- множество прямых и обратных дуг цикла L_q соответственно. Число

$$R_p(L_q) = \sum_{(i, j) \in L_q} \lambda_{ij}^{kp} \text{sign}(i, j)^q, \quad k = \begin{cases} 1, & q \leq l_1, \\ 2, & q > l_1 \end{cases}$$

назовем детерминантом цикла L_q относительно p -го ограничения из (4), функция определяется соотношением

$$\text{sign}(i, j)^q = \begin{cases} 1, & \text{если } (i, j) \in L_q^+, \\ -1, & \text{если } (i, j) \in L_q^-, \\ 0, & \text{если } (i, j) \in \overline{L_q}. \end{cases}$$

Дуга $(i_1^t, i_2^t) \in U_{\text{он}}$ называется ациклической, если $(i_1^t, i_2^t) \in U_a^k$, $U_{\text{он}}^k = U_a^k \cap U_a^k = \emptyset$, где $L_t = \{I_t, U_t\}$ — некоторый цикл из множества L . Введем множества U_a^1, U_a^2 ациклических дуг соответственно первого и второго продуктов, $U_a = U_a^1 \cup U_a^2$, $U_a^1 = \bigcup_{t=1}^{l_1} (i_1^t, i_2^t)^k$, $U_a^2 = \bigcup_{t=l_1+1}^{l_1+l_2} (i_1^t, i_2^t)^k$, $k = \begin{cases} 1, & t \leq l_1 \\ 2, & t > l_1 \end{cases}$.

Для каждого цикла составим систему уравнений

$$\begin{aligned} \sum_{i \in I_{\overline{1}}^+(U_t)} \tilde{y}_{it}^k - \sum_{i \in I_{\overline{1}}^-(U_t)} \tilde{y}_{it}^k &= 0, \\ i \in I(U_t), \quad k &= \begin{cases} 1, & t \leq l_1, \\ 2, & t > l_1, \quad t = \overline{1, l_1 + l_2} \end{cases} \end{aligned}$$

из которой однозначно определим потоки \tilde{y}_{it}^k , предварительно положив поток по ациклической дуге равным

$$y_{i_1^t i_2^t}^k = 1, \quad k = \begin{cases} 1, & t \leq l_1 \\ 2, & t > l_1, \quad t = \overline{1, l_1 + l_2}. \end{cases}$$

Упорядочим произвольным образом дуги множества U^* . Пусть $D_l = \{R_p(L_q), q = \overline{1, l_1 + l_2}\} - l \times (l_1 + l_2)$ — матрица, составленная из чисел $\rho = \overline{1, l}$

$R_p(L_p)$, и $D_2 = \{\delta_{\tau(i, j), t} (i_1, i_2)^k, (i_1, i_2)^k \in U_a^k, k = 1, 2\} - |U^*| \times (I_1 + I_2)$ -матрица, составленная из элементов

$$\delta_{\tau(i, j), t} = \begin{cases} y_{ij}^k, & \text{если } (i^t, j^t) \in U_t \cap U^*, \\ 0, & \text{если } (i^t, j^t) \notin U_t \cap U^*, \end{cases}$$

где $\tau(i, j)$ — порядковый номер дуги в U^* , $k = \begin{cases} 1, & t \leq I_1 \\ 2, & t > I_1 \end{cases}$. Составим

$(|U^*| + I) \times (I_1 + I_2)$ — матрицу $D = \begin{Bmatrix} D_1 \\ D_2 \end{Bmatrix}$. Если $I_1 + I_2 \neq |U^*| + I$, то дополним матрицу D нулями до квадратной матрицы. Число $R = \det D$ назовем детерминантом опоры U_{on} .

Теорема (критерий опорности). Для того чтобы совокупность U_{on} была опорой сети S , необходимо и достаточно выполнение условий:

- 1) $I(U_{on}^k) = I, k = 1, 2$;
- 2) $U_{on}^k, k = 1, 2$ — связные множества;
- 3) $R \neq 0$.

Доказательство теоремы аналогично [1]. По опоре U_{on} построим потенциалы $u_i = \{u_i^1, u_i^2\}, i \in I; r_p, p = \overline{1, l}; r_{p_1}, p_1 = \overline{l+1, l+|U^*|}$, как решение системы:

$$u_i^k - u_j^k + \sum_{p=1}^l \lambda_{ij}^{kp} r_p - c_{ij}^k = 0, (i, j) \in U_{on}^k \setminus U^*, \quad (6)$$

$$u_i^k - u_j^k + \sum_{p=1}^l \lambda_{ij}^{kp} r_p - c_{ij}^k = u_i^k - u_j^k + \sum_{p=1}^l \lambda_{ij}^{kp} r_p - c_{ij}^k, (i, j) \in U^*, k = 1, 2.$$

Будем говорить, что $u_i = \{u_i^1, u_i^2\}$ — вектор потенциалов узлов $i \in I$, r_p — потенциал дополнительного ограничения (4), r_{p_1} — потенциал ограничения $x_{ij}^1 + x_{ij}^2 \leq d_{ij}$.

Для нахождения потенциалов $r_p, r_{p_1}, p = \overline{1, l}, p_1 = \overline{l+1, l+|U^*|}$, следуя [1], запишем систему:

$$\sum_{p=1}^l R_p(L_l) r_p + \sum_{p_1=l+1}^{l+|U^*|} r_{p_1} \delta_{\tau(i, j), t} = \sum_{(i, j) \in L_l} c_{ij}^k \text{sign}(i, j)^t \quad (7)$$

Равенство (7) можно переписать в следующем виде:

$$D^t r = c, r = \{r_p, r_{p_1}\}, c = \{c_1, c_2, \dots, c_{l+I_2}\}, \quad (8)$$

$$c_t = \sum_{(i, j) \in L_l} c_{ij}^k \text{sign}(i, j)^t, k = \begin{cases} 1, & t \leq I_1 \\ 2, & t > I_1 \end{cases}$$

Система (8) относительно r имеет единственное решение, так как $R \neq 0$. Величины r_{p_1} , вычисленные из системы (8), обозначим через γ_{ij} , $(i, j) \in U^*$. Имеем

$$\bar{c}_{ij}^k = \begin{cases} c_{ij}^k, & (i, j) \notin U^*, \\ c_{ij}^k - \gamma_{ij}, & (i, j) \in U^*, k = 1, 2. \end{cases}$$

Вместо системы (6) запишем эквивалентную ей систему:

$$u_i^k - u_j^k + \sum_{p=1}^l \lambda_{ij}^{kp} r_p - \bar{c}_{ij}^k = 0, (i, j) \in U_{on}^k, k = 1, 2.$$

Теперь векторы потенциалов $u_i = \{u_i^1, u_i^2\}$ найдем с помощью деревьев $U_a^k, k = 1, 2$ и чисел \bar{c}_{ij}^k , где $U_a^k = U_{on}^k \setminus U_a^k, U_a^k$ — множество ациклических дуг, как в классическом методе потенциалов [2].

Для каждой дуги вычислим вектор оценок

$$\Delta_{ij} = \{\Delta_{ij}^1, \Delta_{ij}^2\}: \Delta_{ij}^k = u_i^k - u_j^k + \sum_{p=1}^l \lambda_{ij}^{kp} r_p - c_{ij}^k, (i, j) \in U, k = 1, 2.$$

Следуя [3], можно доказать

Критерий оптимальности. Если для опорного потока выполняются соотношения:

а) на ненасыщенных дугах ($x_{ij}^1 + x_{ij}^2 < d_{ij}$):

$$\Delta_{ij}^k \leq 0 \text{ при } x_{ij}^k = 0; \quad (9)$$

$$\Delta_{ij}^k = 0 \text{ при } x_{ij}^k > 0, (i, j) \in U, k = 1, 2. \quad (10)$$

б) на насыщенных дугах ($x_{ij}^1 + x_{ij}^2 = d_{ij}$):

$$\Delta_{ij}^1 = \Delta_{ij}^2 \geq 0 \text{ при } x_{ij}^1 > 0, x_{ij}^2 > 0, \quad (11)$$

$$\Delta_{ij}^1 \geq \Delta_{ij}^2, \Delta_{ij}^1 \geq 0 \text{ при } x_{ij}^1 = d_{ij}, x_{ij}^2 = 0, (i, j) \in U. \quad (12)$$

Критерий субоптимальности. Поток $x = \{x_{ij}^{k0}, (i, j) \in U, k = 1, 2\}$ назовем ε -оптимальным (субоптимальным), если

$$\sum_{k=1}^2 \sum_{(i, j) \in U} c_{ij}^k x_{ij}^k - \sum_{k=1}^2 \sum_{(i, j) \in U} c_{ij}^k x_{ij}^{k0} \leq \varepsilon.$$

Для любого ε -оптимального потока выполняется неравенство (13) (доказательство аналогично [1]).

$$\sum_{k=1}^2 \sum_{(i, j) \in U} c_{ij}^k x_{ij}^k - \sum_{k=1}^2 \sum_{(i, j) \in U} c_{ij}^k x_{ij}^{k0} \leq \beta, \quad (13)$$

где $\beta = - \sum_{k=1}^2 \sum_{(i, j) \in U} \Delta_{ij}^k x_{ij}^k - \sum_{(i, j) \in U} (\Delta_{ij}^1 x_{ij}^1 + \Delta_{ij}^2 (x_{ij}^2 - d_{ij}))$.

$$\max_{\{\Delta_{ij}^k, k=1, 2; 0\}} = 0 \max_{\{\Delta_{ij}^1, \Delta_{ij}^2, 0\}} = 0$$

Если для опорного потока $\{x, U_{\text{он}}\}$ приведенные критерии оптимальности (9—12) и субоптимальности (13) не выполняются, опишем алгоритм улучшения потока.

Среди дуг, для которых не выполнен критерий оптимальности, найдем дугу с максимальным нарушением, т. е. если для ненасыщенной дуги не выполнены условия (9)—(10), то помечаем число Δ_{ij}^k , если же для насыщенной дуги не выполнены условия (11)—(12), то при $\max\{\Delta_{ij}^1, \Delta_{ij}^2\} > 0$ помечаем число $\Delta_{ij}^1 - \Delta_{ij}^k$, при $\max\{\Delta_{ij}^k, k = 1, 2\} < 0$ и $x_{ij}^k \geq 0, k = 1, 2$ помечаем число Δ_{ij}^k . Среди отмеченных чисел выбираем максимальное по модулю число. Рассмотрим следующие случаи:

1) максимальное из отмеченных чисел имеет вид Δ_{ij}^k и находится на дуге $(i_0, j_0)^k, (i_0, j_0)^k \in U^*$;

2) максимальное из чисел имеет вид Δ_{ij}^k и находится на дуге $(i_0, j_0)^k, (i_0, j_0)^k \in U^*$;

3) максимальное число имеет вид $\Delta_{ij}^l - \Delta_{ij}^k, l, k = 1, 2, l \neq k$.

Рассмотрим каждый из этих случаев.

1. Не нарушая общности, положим $k = 1$.

Найдем поток $Y (U_{\text{он}}^1 \cup U_{\text{он}}^2 \cup (i_0, j_0)^1) = \{y_{ij}^k, (i, j)^k \in U_{\text{он}}^k, y_{i_0 j_0}^k, k = 1, 2\}$, компоненты которого удовлетворяют системе (5), записанной относительно множества $\{U_{\text{он}}^1 \cup (i_0, j_0)^1, U_{\text{он}}^2, U^*\}$, и условию $y_{i_0 j_0}^k = \text{sign } \Delta_{i_0 j_0}^k$. Аналогично [1] определим вектор α :

$$\alpha = \begin{cases} -R_p(L_0) \cdot y_{i_0 j_0}^1, & p = \overline{1, l} \\ -\tilde{y}_{ij}^0 y_{i_0 j_0}^1, & \text{если } (i, j) \in U^* \cap U^0 \\ 0, & \text{если } (i, j) \in U^* \setminus U^0, \end{cases}$$

где $Z_0 = \{l, U^0\}$ — множество узлов и дуг цикла, образованного дугами $(i_0, j_0)^1$ и $(i, j)^1 \in U_{\text{он}}^1 \setminus U_a^1$, и определим потоки на ациклических дугах.

Потоки на дугах $U_{on}^k \setminus U_a^k$ определяются по формуле:

$$y_{ij}^k = \begin{cases} \sum_{t \in T(i, j)^k} \bar{y}_{i'j'}^k \cdot y_{i't'}^k, & T(i, j)^k \neq \emptyset, \\ 0, & T(i, j)^k = \emptyset, \quad k = \begin{cases} 1, & t \leq l_1 \\ 2, & t > l_1 \end{cases} \end{cases} \quad (14)$$

где $T(i, j)^k = \{t : (i, j)^k \in U^t(i_1, i_2)^k, (i_1, i_2)^k \in U_a^k, (i', j')^k - \text{ациклическая дуга, определившая цикл } Z_t = Z_{t(i_1, i_2)^k}\}$. Новый поток \bar{x} строим в виде: $\bar{x}_{ij}^k = x_{ij}^k + \Theta y_{ij}^k, (i, j)^k \in U_{on}^k, k = 1, 2; \bar{x}_{i_0j_0}^k = x_{i_0j_0}^k + \Theta y_{i_0j_0}^k; \bar{x}_{ij}^k = x_{ij}^k, (i, j)^k \in U^k \setminus U_{on}^k$, где Θ — максимально допустимый шаг, найденный по стандартным правилам [3]. При переходе $x \rightarrow \bar{x}$ стоимость потока уменьшилась на величину $-\Theta |\Delta_{i_0j_0}^k|$. Опорные множества меняем по правилам, указанным в [1].

2. Найдем поток $Y(U_{on}^1 \cup U_{on}^2)$, удовлетворяющий системе (5), записанной относительно множеств $\{U_{on}^1, U_{on}^2, U^* \setminus (i_0, j_0)\}$, и условию $y_{i_0j_0}^1 + y_{i_0j_0}^2 = -1$. Компоненты вектора α и ациклические направления определим аналогично [1]. Из соотношения (14) найдем $y_{ij}^k, (i, j)^k \in U_{on}^k \setminus U_a^k$. Новый поток \bar{x} строим в виде $\bar{x}_{ij}^k = x_{ij}^k + \Theta y_{ij}^k, (i, j)^k \in U_{on}^k, k = 1, 2, \bar{x}_{ij}^k = x_{ij}^k, (i, j)^k \in U_{on}^k, k = 1, 2$, где Θ — максимальный шаг, найденный по стандартным правилам. При переходе $x \rightarrow \bar{x}$ стоимость потока уменьшится на величину $\Theta |\Delta_{i_0j_0}^k|$. Опорные множества меняем по правилам, указанным в [1].

3. Найдем потоки $\{y_{ij}^k, (i, j)^k \in U_{on}^k, y_{i_0j_0}^k, k = 1, 2\}$, удовлетворяющие системе (5), записанной относительно множеств $\{U_{on}^1 \cup (i_0, j_0)^1, U_{on}^2 \cup (i_0, j_0)^2, U^* \cup (i_0, j_0)\}$, при условиях $y_{i_0j_0}^1 = \text{sign}(\Delta_{i_0j_0}^1 - \Delta_{i_0j_0}^2), y_{i_0j_0}^2 = -\text{sign}(\Delta_{i_0j_0}^1 - \Delta_{i_0j_0}^2)$. Подходящие направления изменения потока найдем так же, как и в [1].

Новый поток \bar{x} строим в виде $\bar{x}_{ij}^k = x_{ij}^k + \Theta y_{ij}^k, (i, j)^k \in U_{on}^k \cup (i_0, j_0)^k, \bar{x}_{ij}^k = x_{ij}^k, (i, j)^k \in U_{on}^k \cup (i_0, j_0)^k, k = 1, 2, \Theta$ — максимально-допустимый шаг, найденный по стандартным правилам. Стоимость потока уменьшается на величину $\Theta |\Delta_{i_0j_0}^1 - \Delta_{i_0j_0}^2|$. Опора преобразуется по правилам, указанным в [1].

ЛИТЕРАТУРА

1. Пилипчук Л. А. Мультипоток минимальной стоимости с дополнительными ограничениями на частичные суммы дуговых потоков. — Рукопись депонирована в ВИННИТИ, № 2522-81. Деп. от 28.05.81.
2. Данциг Дж. Линейное программирование, его обобщения и применения. — М., 1966.
3. Габасов Р., Кириллова Ф. М. Методы линейного программирования. — Минск, 1980, ч. 2.

Поступила в редакцию
12.07.82.

Кафедра МОУ

УДК 517.948.32

Л. А. ХВОШИНСКАЯ

ЗАМКНУТОЕ РЕШЕНИЕ ОДНОЙ КРАЕВОЙ ЗАДАЧИ

Рассмотрим трехэлементную краевую задачу: найти функцию $\Phi(z)$, аналитическую во внешности отрезка $0 \leq x \leq 1$, предельные значения ко-