

Problema 5

Sia dato un problema di PL in forma standard e il suo duale. Sia Opt il valore ottimo comune dei due problemi. Siano $\bar{x} \in S_a$ e $\bar{u} \in D_a$. Si dimostri che dato $\varepsilon \geq 0$

$$(\bar{u}A - c)\bar{x} \leq \varepsilon$$

implica

$$c\bar{x} \geq Opt - \varepsilon$$

ovvero il valore dell'obiettivo in $\bar{x}$ non differisce per più di ε dal valore ottimo del problema primale.