TỐI ƯU CÓ RÀNG BUỘC

Dương Thị Kim Huyền – Tạ Thúy Anh

Khoa công nghệ thông tin
Đại học PHENIKAA

Hà Nội - 2023

1. Bài toán tối ưu có ràng buộc

2. Điều kiện KKT

Bài toán tối ưu có ràng buộc

Bài toán tối ưu lồi

- Hàm mục tiêu (objective function): lồi
- Tập chấp nhận được (feasible set): lồi

Bài toán tối ưu lồi

- Hàm mục tiêu (objective function): lồi
- Tập chấp nhận được (feasible set): lồi

Bài toán tối ưu lồi tổng quát

$$
\begin{array}{lll}
(P) & \text{Minimize} & f(x) \\
& \text{subject to} & g_i(x) \leqslant 0, i = 1, 2, \dots, n \\
& & h_j(x) = 0, j = 1, 2, \dots, p \\
& & x \in \mathbb{R}^n.
\end{array}
$$

- x là biến số
- $f : \mathcal{D} \subset \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là hàm mục tiêu
- $g_i : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm lồi
- $h_j(x) : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm affine

Bài toán tối ưu lồi tổng quát

$$
(P) \qquad \begin{array}{ll} \text{Minimize} & f(x) \\ \text{subject to} & g_i(x) \leqslant 0, i = 1, 2, \ldots, n \\ & h_j(x) = 0, j = 1, 2, \ldots, p \\ & x \in \mathbb{R}^n. \end{array}
$$

- x là biến số
- $f : \mathcal{D} \subset \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là hàm mục tiêu
- $g_i : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm lồi
- $h_j(x) : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm affine

Bài toán tối ưu lồi tổng quát

$$(P) \qquad \begin{array}{ll} \text{Minimize} & f(x) \\ \text{subject to} & g_i(x) \leqslant 0, i = 1, 2, \ldots, n \\ & h_j(x) = 0, j = 1, 2, \ldots, p \\ & x \in \mathbb{R}^n. \end{array}$$

- x là biến số
- $f : \mathcal{D} \subset \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là hàm mục tiêu
- $g_i : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm lồi
- $h_j(x) : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm affine

Bài toán tối ưu lồi tổng quát

$$
(P) \qquad \begin{array}{ll} \text{Minimize} & f(x) \\ \text{subject to} & g_i(x) \leqslant 0, i = 1, 2, \ldots, n \\ & h_j(x) = 0, j = 1, 2, \ldots, p \\ & x \in \mathbb{R}^n. \end{array}
$$

- x là biến số
- $f : \mathcal{D} \subset \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là hàm mục tiêu
- $g_i : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm lồi
- $h_j(x) : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm affine

Bài toán tối ưu lồi tổng quát

$$
(P) \qquad \begin{array}{ll} \text{Minimize} & f(x) \\ \text{subject to} & g_i(x) \leqslant 0, i = 1, 2, \dots, n \\ & h_j(x) = 0, j = 1, 2, \dots, p \\ & x \in \mathbb{R}^n. \end{array}
$$

- x là biến số
- $f : \mathcal{D} \subset \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là hàm mục tiêu
- $g_i : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm lồi
- $h_j(x) : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$ là các hàm affine

Bài toán tối ưu lồi

Các bài toán sau là bài toán tối ưu lồi hoặc có thể chuyển về một bài toán tối ưu lồi

- Least squares
- Linear programming
- Convex quadratic minimization with linear constraints
- Quadratic minimization with convex quadratic constraints
- Conic optimization
- Geometric programming
- Second order cone programming

Bài toán tối ưu lồi

Các bài toán sau là bài toán tối ưu lồi hoặc có thể chuyển về một bài toán tối ưu lồi

- Least squares
- Linear programming
- Convex quadratic minimization with linear constraints
- Quadratic minimization with convex quadratic constraints
- Conic optimization
- Geometric programming
- Second order cone programming

Bài toán tối ưu lồi

Các bài toán sau là bài toán tối ưu lồi hoặc có thể chuyển về một bài toán tối ưu lồi

- Least squares
- Linear programming
- Convex quadratic minimization with linear constraints
- Quadratic minimization with convex quadratic constraints
- Conic optimization
- Geometric programming
- Second order cone programming

Bài toán tối ưu lồi

Các bài toán sau là bài toán tối ưu lồi hoặc có thể chuyển về một bài toán tối ưu lồi

- Least squares
- Linear programming
- Convex quadratic minimization with linear constraints
- Quadratic minimization with convex quadratic constraints
- Conic optimization
- Geometric programming
- Second order cone programming

Bài toán tối ưu lồi

Các bài toán sau là bài toán tối ưu lồi hoặc có thể chuyển về một bài toán tối ưu lồi

- Least squares
- Linear programming
- Convex quadratic minimization with linear constraints
- Quadratic minimization with convex quadratic constraints
- Conic optimization
- Geometric programming
- Second order cone programming

Bài toán tối ưu lồi

Các bài toán sau là bài toán tối ưu lồi hoặc có thể chuyển về một bài toán tối ưu lồi

- Least squares
- Linear programming
- Convex quadratic minimization with linear constraints
- Quadratic minimization with convex quadratic constraints
- Conic optimization
- Geometric programming
- Second order cone programming

Bài toán tối ưu lồi

Các bài toán sau là bài toán tối ưu lồi hoặc có thể chuyển về một bài toán tối ưu lồi

- Least squares bình phương nhỏ nhất
- Linear programming
- Convex quadratic minimization with linear constraints
- Quadratic minimization with convex quadratic constraints
- Conic optimization
- Geometric programming
- Second order cone programming

Bài toán tối ưu lồi

Các bài toán sau là bài toán tối ưu lồi hoặc có thể chuyển về một bài toán tối ưu lồi

- Least squares
- Linear programming
- Convex quadratic minimization with linear constraints
- Quadratic minimization with convex quadratic constraints
- Conic optimization
- Geometric programming
- Second order cone programming

Những bài toán tối ưu lồi có nhiều ứng dụng

- Portfolio optimization
- Worst-case risk analysis
- Optimal advertising
- Variations of statistical regression (including regularization and quantile regression)
- Model fitting (particularly multiclass classification)
- Electricity generation optimization
- Combinatorial optimization
- Non-probabilistic modelling of uncertainty
- Localization using wireless signals

Những bài toán tối ưu lồi có nhiều ứng dụng

- Portfolio optimization
- Worst-case risk analysis
- Optimal advertising
- Variations of statistical regression (including regularization and quantile regression)
- Model fitting (particularly multiclass classification)
- Electricity generation optimization
- Combinatorial optimization
- Non-probabilistic modelling of uncertainty
- Localization using wireless signals

Những bài toán tối ưu lồi có nhiều ứng dụng

- Portfolio optimization
- Worst-case risk analysis
- Optimal advertising
- Variations of statistical regression (including regularization and quantile regression)
- Model fitting (particularly multiclass classification)
- Electricity generation optimization
- Combinatorial optimization
- Non-probabilistic modelling of uncertainty
- Localization using wireless signals

Những bài toán tối ưu lồi có nhiều ứng dụng

- Portfolio optimization
- Worst-case risk analysis
- Optimal advertising
- Variations of statistical regression (including regularization and quantile regression)
- Model fitting (particularly multiclass classification)
- Electricity generation optimization
- Combinatorial optimization
- Non-probabilistic modelling of uncertainty
- Localization using wireless signals

Những bài toán tối ưu lồi có nhiều ứng dụng

- Portfolio optimization
- Worst-case risk analysis
- Optimal advertising
- Variations of statistical regression (including regularization and quantile regression)
- Model fitting (particularly multiclass classification)
- Electricity generation optimization
- Combinatorial optimization
- Non-probabilistic modelling of uncertainty
- Localization using wireless signals

Những bài toán tối ưu lồi có nhiều ứng dụng

- Portfolio optimization
- Worst-case risk analysis
- Optimal advertising
- Variations of statistical regression (including regularization and quantile regression)
- Model fitting (particularly multiclass classification)
- Electricity generation optimization
- Combinatorial optimization
- Non-probabilistic modelling of uncertainty
- Localization using wireless signals

Những bài toán tối ưu lồi có nhiều ứng dụng

- Portfolio optimization
- Worst-case risk analysis
- Optimal advertising
- Variations of statistical regression (including regularization and quantile regression)
- Model fitting (particularly multiclass classification)
- Electricity generation optimization
- Combinatorial optimization
- Non-probabilistic modelling of uncertainty
- Localization using wireless signals

Những bài toán tối ưu lồi có nhiều ứng dụng

- Portfolio optimization
- Worst-case risk analysis
- Optimal advertising
- Variations of statistical regression (including regularization and quantile regression)
- Model fitting (particularly multiclass classification)
- Electricity generation optimization
- Combinatorial optimization
- Non-probabilistic modelling of uncertainty
- Localization using wireless signals

Những bài toán tối ưu lồi có nhiều ứng dụng

- Portfolio optimization
- Worst-case risk analysis
- Optimal advertising
- Variations of statistical regression (including regularization and quantile regression)
- Model fitting (particularly multiclass classification)
- Electricity generation optimization
- Combinatorial optimization
- Non-probabilistic modelling of uncertainty
- Localization using wireless signals

$$
(P) \qquad \begin{array}{ll} \text{Minimize} & f(x) \\ \text{subject to} & g_i(x) \leqslant 0, i = 1, 2, \ldots, n \\ & h_j(x) = 0, j = 1, 2, \ldots, p \\ & x \in \mathbb{R}^n. \end{array}
$$

Đặt $I = \{1, 2, \ldots, n\}$, $J = \{1, 2, \ldots, p\}$.

- I, J là các tập chỉ số.

Đặt $C = \{x \in \mathbb{R}^n : g_i(x) \leqslant 0 \ \forall i \in I, \ \ h_j(x) = 0 \ \forall j \in J\}$

- C là tập chấp nhận được

$$
(P) \qquad \begin{array}{ll} \text{Minimize} & f(x) \\ \text{subject to} & g_i(x) \leqslant 0, i = 1, 2, \ldots, n \\ & h_j(x) = 0, j = 1, 2, \ldots, p \\ & x \in \mathbb{R}^n. \end{array}
$$

Đặt $I = \{1, 2, \ldots, n\}$, $J = \{1, 2, \ldots, p\}$.

- I, J là các tập chỉ số.

Đặt $C = \{x \in \mathbb{R}^n : g_i(x) \leqslant 0\ \forall i \in I,\ h_j(x) = 0\ \forall j \in J\}$

- C là tập chấp nhận được

$$
(P) \qquad \begin{array}{ll} \text{Minimize} & f(x) \\ \text{subject to} & g_i(x) \leqslant 0, i = 1, 2, \ldots, n \\ & h_j(x) = 0, j = 1, 2, \ldots, p \\ & x \in \mathbb{R}^n. \end{array}
$$

Đặt $I = \{1, 2, \ldots, n\}$, $J = \{1, 2, \ldots, p\}$.

- I, J là các tập chỉ số.

Đặt $C = \{x \in \mathbb{R}^n : g_i(x) \leqslant 0 \ \forall i \in I, \ h_j(x) = 0 \ \forall j \in J\}$

- C là tập chấp nhận được

$$
\begin{array}{lll}
(P) & \text{Minimize} & f(x) \\
 & \text{subject to} & g_i(x) \leqslant 0, i = 1, 2, \ldots, n \\
 & & h_j(x) = 0, j = 1, 2, \ldots, p \\
 & & x \in \mathbb{R}^n.
\end{array}
$$

Đặt $I = \{1, 2, \ldots, n\}$, $J = \{1, 2, \ldots, p\}$.

- I, J là các tập chỉ số.

Đặt $C = \{x \in \mathbb{R}^n : g_i(x) \leqslant 0 \ \forall i \in I, \ h_j(x) = 0 \ \forall j \in J\}$

- C là tập chấp nhận được

Điều kiện KKT

điều kiện tìm điểm dừng

Điều kiện cần cực trị

Nếu x^* là một nghiệm bài toán (P) *thì* tồn tại các hằng số λ_i $(i \in I)$, μ_j $(j \in J)$ sao cho

$$\begin{cases} \nabla f(x^*) + \sum\limits_{i \in I} \lambda_i \nabla g_i(x^*) + \sum\limits_{j \in J} \mu_j \nabla h_j(x^*) = 0 \\ \lambda_i g_i(x^*) = 0 \;\; \forall i \in I \\ g_i(x^*) \leqslant 0 \;\; \forall i \in I, \;\; h_j(x^*) = 0 \;\; \forall j \in J \\ \lambda_i \geqslant 0 \;\; \forall i \in I, \;\; \mu_j \in \mathbb{R} \;\; \forall j \in J \end{cases} \tag{1}$$

Điểm x^* thỏa mãn hệ ràng buộc (1) được gọi là một điểm *KKT* (Karush-Kuhn-Tucker) của bài toán

- Điều kiện $\lambda_i g_i(x^*) = 0$: điều kiện bù
- Các nhân tử λ_i, μ_j: nhân tử Lagrange

Điểm x^* thỏa mãn hệ ràng buộc (1) được gọi là một điểm *KKT* (Karush-Kuhn-Tucker) của bài toán

- Điều kiện $\lambda_i g_i(x^*) = 0$: điều kiện bù
- Các nhân tử λ_i, μ_j: nhân tử Lagrange

Điều kiện cần và đủ

x^* là nghiệm bài toán (P) *khi và chỉ khi* x^* là điểm KKT.

Ví dụ 2

Tìm cực tiểu của hàm số $f(x, y) = (x - 1)^2 + y - 2$ thỏa mãn

$$\begin{cases} x + y - 2 \leqslant 0 \\ x - y + 1 = 0 \end{cases}$$

Bài tập 2

Tìm cực đại của hàm số $f(x,y) = x^2 + y^2 + 4x - 6y$ thỏa mãn

$$\begin{cases} x + y \leqslant 3 \\ -2x + y \leqslant 2 \end{cases}$$

Bài toán tối ưu không lồi

Điểm KKT có thể không là nghiệm BT tối ưu

Ví dụ: Tìm cực đại của hàm số $f(x,y) = xy$ thỏa mãn

$$\begin{cases} x^2 + y^2 \leqslant 2 \\ x \geqslant 0 \\ y \geqslant 0 \end{cases}$$

Bài toán tối ưu không lồi

Điểm KKT có thể không là nghiệm BT tối ưu

Ví dụ: Tìm cực đại của hàm số $f(x, y) = xy$ thỏa mãn

$$\begin{cases} x^2 + y^2 \leqslant 2 \\ x \geqslant 0 \\ y \geqslant 0 \end{cases}$$