

Методы оптимизации.

Семинар 10. Двойственность.

Александр Катруца

Московский физико-технический институт,
Факультет Управления и Прикладной Математики

14 октября 2016 г.

- Существование решения оптимизационной задачи
- Условия оптимальности для
 - общей задачи оптимизации
 - задачи безусловной оптимизации
 - задачи оптимизации с ограничениями типа равенств
 - задачи оптимизации с ограничениями типа равенств и неравенств

Задача

$$\begin{aligned} \min_{x \in \mathcal{D}} f(x) &= p^* \\ \text{s.t. } g_i(x) &= 0, \quad i = 1, \dots, m \\ h_j(x) &\leq 0, \quad j = 1, \dots, p \end{aligned}$$

Лагранжиан

$$L(x, \lambda, \mu) = f(x) + \sum_{i=1}^m \lambda_i g_i(x) + \sum_{j=1}^p \mu_j h_j(x)$$

Двойственные переменные

Вектора μ и λ называются двойственными переменными.

Двойственная функция

Функция $g(\mu, \lambda) = \inf_{x \in \mathcal{D}} L(x, \lambda, \mu)$ называется двойственной функцией Лагранжа.

Свойства двойственной функции

Вогнутость

Двойственная функция является **вогнутой** как инфимум аффинных функций по (μ, λ) в независимости от того, является ли исходная задача выпуклой.

Нижняя граница

Для любого λ и для $\mu \geq 0$ выполнено $g(\mu, \lambda) \leq p^*$.

Двойственная задача

$$\begin{aligned} \max g(\mu, \lambda) &= d^* \\ \text{s.t. } \mu &\geq 0 \end{aligned}$$

Зачем?

- Двойственная задача выпукла независимо от того, выпукла ли прямая
- Нижняя оценка **может** достигаться

Связь с сопряжённой функцией

Рассмотрим задачу

$$\begin{aligned} \min f_0(x) \\ \text{s.t. } \mathbf{Ax} \leq \mathbf{b} \\ \mathbf{Cx} = \mathbf{d} \end{aligned}$$

Тогда

$$\begin{aligned} g(\boldsymbol{\lambda}, \boldsymbol{\mu}) &= \inf_x (f_0(x) + \boldsymbol{\lambda}^\top (\mathbf{Ax} - \mathbf{b}) + \boldsymbol{\mu}^\top (\mathbf{Cx} - \mathbf{d})) = \\ &= -\mathbf{b}^\top \boldsymbol{\lambda} - \boldsymbol{\mu}^\top \mathbf{d} + \inf_x (f_0(x) + (\mathbf{A}^\top \boldsymbol{\lambda} + \mathbf{C}^\top \boldsymbol{\mu})^\top x) = \\ &= -\mathbf{b}^\top \boldsymbol{\lambda} - \boldsymbol{\mu}^\top \mathbf{d} - f_0^*(-\mathbf{A}^\top \boldsymbol{\lambda} - \mathbf{C}^\top \boldsymbol{\mu}) \end{aligned}$$

Области определений двойственной и сопряжённой функций связаны:

$$\text{dom } g = \{(\boldsymbol{\lambda}, \boldsymbol{\mu}) \mid -\mathbf{A}^\top \boldsymbol{\lambda} - \mathbf{C}^\top \boldsymbol{\mu} \in \text{dom } f_0^*\}$$

Примеры

Найти двойственную функцию:

- Решение СЛУ минимальной нормы

$$\begin{aligned} \min \|\mathbf{x}\|_2^2 \\ \text{s.t. } \mathbf{Ax} = \mathbf{b} \end{aligned}$$

- Линейное программирование

$$\begin{aligned} \min \mathbf{c}^T \mathbf{x} \\ \text{s.t. } \mathbf{Ax} = \mathbf{b} \\ \mathbf{x} \geq 0 \end{aligned}$$

- Задача разбиения

$$\begin{aligned} \min \mathbf{x}^T \mathbf{W} \mathbf{x} \\ \text{s.t. } x_i^2 = 1, \quad i = 1, \dots, n \end{aligned}$$

Слабая и сильная двойственность

Определение

Оптимальные значения целевой функции в прямой и двойственной задаче связаны соотношением

$$d^* \leq p^*.$$

Если $d^* < p^*$, то свойство называют слабой двойственностью.
Если $d^* = p^*$, то — сильной двойственностью.

Замечание

Слабая двойственность есть всегда по построению двойственной задачи.

Вопросы

- При каких условиях выполняется сильная двойственность?
- Как использовать двойственность для проверки оптимальности?

Теорема

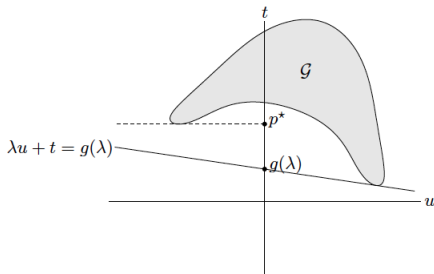
Если задача выпуклая и существует x , лежащий внутри допустимой области, т.е. ограничения типа неравенств выполнены как строгие неравенства, то выполнено свойство сильной двойственности.

- Решение СЛАУ наименьшей нормы
- Линейное программирование
- Квадратичное программирование с квадратичными ограничениями
- Невыпуклая задача с сильной двойственностью

Геометрическая интерпретация

$$\min_x f_0(x), \text{ where } f_1(x) \leq 0.$$

$$g(\lambda) = \inf_{(u,t) \in \mathcal{G}} (t + \lambda u) \quad \mathcal{G} = \{(f_1(x), f_0(x)) \mid x \in \mathcal{D}\}$$



- $\lambda = 0$
- λ^* — оптимальное значение
- $\lambda > \lambda^*$

Условия дополняющей нежёсткости

Пусть \mathbf{x}^* и $(\boldsymbol{\mu}^*, \boldsymbol{\lambda}^*)$ решения прямой и двойственной задачи. То есть

$$\begin{aligned} f(\mathbf{x}^*) &= g(\boldsymbol{\mu}^*, \boldsymbol{\lambda}^*) = \inf_{\mathbf{x}} L(\mathbf{x}, \boldsymbol{\lambda}, \boldsymbol{\mu}) \leq \\ f(\mathbf{x}^*) + \sum_{i=1}^m \lambda_i^* g_i(\mathbf{x}^*) + \sum_{j=1}^p \mu_j^* h_j(\mathbf{x}^*) &\leq \\ f(\mathbf{x}^*), \quad \boldsymbol{\mu} &\geq 0 \end{aligned}$$

Условия дополняющей нежёсткости

$$\mu_j^* h_j(\mathbf{x}^*) = 0, \quad j = 1, \dots, p$$

Для каждого неравенства либо множитель Лагранжа равен нулю, либо оно активно.

Условия Каруша-Куна-Таккера

Механическая интерпретация



$$\min_{\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n} \sum_{i=1}^n x_i \log x_i$$

$$\text{s.t. } \mathbf{Ax} \leq \mathbf{b}$$

$$\mathbf{1}^\top \mathbf{x} = 1$$

