

最优化算法作业 1

陈文轩

更新: March 25, 2025

1. 考虑以下问题:

$$\begin{aligned} \min_{x \in \mathbb{R}^2} \quad & x_1^2 + x_2^2 \\ \text{s.t.} \quad & (x_1 - 1)^2 + (x_2 - 1)^2 \leq 2 \\ & (x_1 - 1)^2 + (x_2 + 1)^2 \leq 2 \end{aligned}$$

其中 $x = (x_1, x_2)^\top \in \mathbb{R}^2$ 。

- (a). 这是一个凸优化问题吗?
- (b). 写出此问题的拉格朗日函数。使用 Slater 条件验证在这个问题中是否存在强对偶性。
- (c). 写出这个优化问题的 KKT 条件。求出 KKT 点和最优点。

解

- (a). 由于目标函数与约束函数均为二次函数, 且 Hessian 矩阵为 $2I_2$, 故是凸优化问题。
- (b). 引入非负 Lagrange 乘子 $\lambda_1, \lambda_2 \geq 0$, 可以得到问题的 Lagrange 函数为:

$$L(x, \lambda_1, \lambda_2) = x_1^2 + x_2^2 + \lambda_1((x_1 - 1)^2 + (x_2 - 1)^2 - 2) + \lambda_2((x_1 - 1)^2 + (x_2 + 1)^2 - 2)$$

取 $x = (1, 0)^\top$, 显然这个 x 满足严格不等式, 故 Slater 条件成立, 即具有强对偶性。

- (c). KKT 条件为:

$$\begin{cases} \nabla_x L(x, \lambda_1, \lambda_2) = 2(x_1 + (\lambda_1 + \lambda_2)(x_1 - 1), x_2 + (\lambda_1 + \lambda_2)(x_2 - 1)) = 0 \\ \lambda_1((x_1 - 1)^2 + (x_2 - 1)^2 - 2) = 0, \lambda_2((x_1 - 1)^2 + (x_2 + 1)^2 - 2) = 0 \\ (x_1 - 1)^2 + (x_2 - 1)^2 \leq 2, (x_1 - 1)^2 + (x_2 + 1)^2 \leq 2 \\ \lambda_1 \geq 0, \lambda_2 \geq 0 \end{cases}$$

解得 $x_1 = x_2 = \lambda_1 = \lambda_2 = 0$, 即 $(0, 0)^\top$ 是 KKT 点, 也是最优点。

2. 考虑一个凸的分段线性最小化问题, 变量为 $x \in \mathbb{R}^n$

$$\min \max_{i=1, \dots, m} (a_i^\top x + b_i)$$

其中 $a_i \in \mathbb{R}^n, b_i \in \mathbb{R}$ 。

(a). 考虑原问题的如下等价问题2.1，推导2.1的对偶问题

$$\begin{aligned} \min \quad & \max_{i=1, \dots, m} y_i \\ \text{s.t.} \quad & a_i^\top x + b_i \leq y_i, i = 1, \dots, m \end{aligned} \quad (2.1)$$

变量为 $x \in \mathbb{R}^n, y \in \mathbb{R}^m$ 。

(b). 假设我们通过平滑函数逼近目标函数, 逼近函数为:

$$f_0(x) = \log \sum_{i=1}^m \exp(a_i^\top x + b_i)$$

现在我们考虑无约束问题, 即 $\min f_0(x)$ 。证明该问题的对偶问题如下:

$$\begin{aligned} \max \quad & b^\top z - \sum_{i=1}^m z_i \log z_i \\ \text{s.t.} \quad & A^\top z = 0, \mathbf{1}^\top z = 1, z \succeq 0. \end{aligned} \quad (2.2)$$

其中 $\mathbf{1}$ 表示全是 1 的向量。

(c). 设问题2.1的最优函数值是 p_1^* , 问题2.2的最优函数值是 p_2^* , 证明 $0 \leq p_2^* - p_1^* \leq \log m$ 。

解

(a). 先转化为线性规划问题:

$$\begin{aligned} \min \quad & t \\ \text{s.t.} \quad & a_i^\top x + b_i \leq t, i = 1, \dots, m \end{aligned}$$

Lagrange 函数为 $L(x, t, \lambda) = t + \sum_{i=1}^m \lambda_i (a_i^\top x + b_i - t)$, $\lambda_i \geq 0$, 目标是 $\max_{\lambda} \min_{x, t} L(x, t, \lambda)$ 。

$$\nabla_t L(x, t, \lambda) = 1 - \sum_{i=1}^m \lambda_i = 0 \Rightarrow \mathbf{1}^\top \lambda = 1, \nabla_x L(x, t, \lambda) = \sum_{i=1}^m \lambda_i a_i = 0,$$

此时 $L(x, y, \lambda) = \sum_{i=1}^m \lambda_i b_i$ 。因此对偶问题是:

$$\begin{aligned} \max \quad & \sum_{i=1}^m \lambda_i b_i \\ \text{s.t.} \quad & \mathbf{1}^\top \lambda = 1, \sum_{i=1}^m \lambda_i a_i = 0 \\ & \lambda_i \geq 0, i = 1, \dots, m \end{aligned}$$

(b). 记 $A = (a_1, \dots, a_m)$, $z_j = \frac{\exp(a_j^\top x + b_j)}{\sum_{i=1}^m \exp(a_i^\top x + b_i)}$, 则 $\sum_{j=1}^m z_j = 1, z_j \geq 0$ 。

$$\text{此时 } f_0(x) = \log \sum_{i=1}^m \exp(a_i^\top x + b_i) = \sum_{i=1}^m z_i (a_i^\top x + b_i) - \sum_{i=1}^m z_i \log z_i := L(x, z)。$$

$$\nabla_x L(x, z) = \sum_{i=1}^m z_i a_i = 0 \Rightarrow A^\top z = 0, \text{ 此时 } L(x, z) = b^\top z - \sum_{i=1}^m z_i \log z_i。$$

因此对偶问题是:

$$\begin{aligned} \max \quad & b^\top z - \sum_{i=1}^m z_i \log z_i \\ \text{s.t.} \quad & A^\top z = 0, \mathbf{1}^\top z = 1, z \succeq 0. \end{aligned}$$

(c). 记 $M = \max_i (a_i^\top x + b_i)$, 则 $\exp(M) \leq \sum_{i=1}^m \exp(a_i^\top x + b_i) \leq m \exp(M)$ 。

取对数, 即有 $M \leq \log \sum_{i=1}^m \exp(a_i^\top x + b_i) \leq M + \log m, \forall x$ 。

对问题2.2的最优解 x_2^* , 有 $p_2^* = \log \sum_{i=1}^m \exp(a_i^\top x_2^* + b_i)$, 由上有 $\max_i (a_i^\top x_2^* + b_i) \leq p_2^*$ 。

又 $p_1^* = \min_x \max_i (a_i^\top x + b_i) \leq \max_i (a_i^\top x_2^* + b_i) \leq p_2^*$, 故 $p_1 \leq p_2$ 。

对问题2.1的最优解 x_1^* , 有 $\max_i (a_i^\top x_1^* + b_i) = p_1^*$ 。由上有 $\log \sum_{i=1}^m \exp(a_i^\top x_1^* + b_i) \leq$

$p_1^* + \log m$ 。又 $p_2^* = \min_x \log \sum_{i=1}^m \exp(a_i^\top x + b_i) \leq p_1^* + \log m$, 故 $p_2^* \leq p_1^* + \log m$ 。

综上所述有 $0 \leq p_2^* - p_1^* \leq \log m$ 。

3. 若 $f(x) = \|x\|$ 表示任意范数, $x \in \mathbb{R}^n$, 证明次微分集合如下:

$$\partial f(x) = \{g \in \mathbb{R}^n : \|g\|_* \leq 1, \langle g, x \rangle = \|x\|\},$$

其中 $\|g\|_*$ 表示对偶范数。

解

由次微分定义, 有 $g \in \partial f(x) \Rightarrow f(y) \geq f(x) + \langle g, y - x \rangle, \forall y$, 即 $\|y\| \geq \|x\| + \langle g, y - x \rangle, \forall y$ 。
分以下情况讨论:

- 若 $x = 0$, 则 $\langle g, x \rangle = \|x\|$ 显然成立;
- 对 $x \neq 0$, 取 $y = 0$, 则 $0 \geq \|x\| + \langle g, -x \rangle \Leftrightarrow \langle g, x \rangle \geq \|x\|$;

取 $y = 2x$, 则 $2\|x\| \geq \|x\| + \langle g, x \rangle \Leftrightarrow \langle g, x \rangle \leq \|x\|$ 。故 $\langle g, x \rangle = \|x\|$ 。

而 $g \in \partial f(x) \Rightarrow \|y\| \geq \langle g, y \rangle, \forall y$ 。令 $v = \frac{y}{\|y\|}, t = \|y\|$, 则条件变为:

$t\|v\| \geq t\langle g, v \rangle \Leftrightarrow \langle g, v \rangle \leq 1, \forall \|v\| = 1$ 。由对偶范数定义, 这等价于 $\|g\|_* = \sup_{\|v\|=1} \langle g, v \rangle \leq 1$ 。

故 $\{g \in \mathbb{R}^n : \|g\|_* \leq 1, \langle g, x \rangle = \|x\|\} \subset \partial f(x)$ 。

反之, 若 $g \in \mathbb{R}^n$ 满足 $\|g\|_* \leq 1, \langle g, x \rangle = \|x\|$,

则 $\|y\| \geq \|y\| \cdot \|g\|_* \geq \langle g, y \rangle = \langle g, y - x \rangle + \langle g, x \rangle = \|x\| + \langle g, y - x \rangle, \forall y \Rightarrow g \in \partial f(x)$ 。

故 $\partial f(x) \subset \{g \in \mathbb{R}^n : \|g\|_* \leq 1, \langle g, x \rangle = \|x\|\} \Rightarrow \partial f(x) = \{g \in \mathbb{R}^n : \|g\|_* \leq 1, \langle g, x \rangle = \|x\|\}$ 。

4. 对于 $y \in \mathbb{R}^m$, 给定 μ -强凸, L -光滑函数 $g(y)$, 即 $\nabla g(y)$ 的 Lipchitz 常数为 L 。若 $A \in \mathbb{R}^{m \times n}, m \leq n$ 是行满秩矩阵, 证明:

(a). $f(x) = g(Ax)$ 是 \bar{L} -光滑的, 其中

$$\bar{L} = L\|A\|^2$$

$\|A\|$ 表示矩阵 A 的谱范数。

(b). $f(x) = g(Ax)$ 满足规则性条件, 即

$$\langle \nabla f(x), x - x_{\text{proj}} \rangle \geq \bar{\mu} \|x - x_{\text{proj}}\|^2$$

其中 x_{proj} 表示 x 到函数 $f(x)$ 最小值解集合的正交投影点, $\bar{\mu} = \mu \lambda_{\min}(AA^\top)$ 。

解

(a). 由于 $\nabla f(x) = A^\top \nabla g(Ax)$, 有:

$$\begin{aligned}\|\nabla f(x_1) - \nabla f(x_2)\| &= \|A^\top \nabla g(Ax_1) - A^\top \nabla g(Ax_2)\| \leq \|A^\top\| \cdot \|\nabla g(x_1) - \nabla g(x_2)\| \\ &\leq \|A^\top\| \cdot L \cdot \|Ax_1 - Ax_2\| \leq \|A^\top\| \cdot L \cdot \|A\| \cdot \|x_1 - x_2\| \\ &= \|A\|^2 \cdot L \cdot \|x_1 - x_2\| := \bar{L} \|x_1 - x_2\|\end{aligned}$$

故 $f(x)$ 是 \bar{L} -光滑的。

(b). 由 $g(y)$ μ -强凸, 有 $g(y)$ 有唯一的最小值点 y^* , 且 $\nabla f(y^*) = 0$ 。 A 行满秩 $\Rightarrow AA^\top \succ 0$ 。

此时 $\mu\|y - y^*\|^2 \leq \langle \nabla g(y) - \nabla g(y^*), y - y^* \rangle = \langle \nabla g(Ax), Ax - y^* \rangle$ 。

又 $\forall v \in \text{Row}(A), \|Av\|^2 \geq \lambda_{\min}(AA^\top)\|v\|^2, x - x_{\text{proj}} \in \text{Col}(A^\top) = \text{Row}(A)$

$$\begin{aligned}\langle \nabla f(x), x - x_{\text{proj}} \rangle &= \langle A^\top \nabla g(Ax), x - x_{\text{proj}} \rangle = \langle \nabla g(Ax), A(x - x_{\text{proj}}) \rangle \\ &= \langle \nabla g(Ax), Ax - y^* \rangle \geq \mu \|Ax - y^*\|^2 = \mu \|A(x - x_{\text{proj}})\|^2 \\ &\geq \mu \lambda_{\min}(AA^\top) \|x - x_{\text{proj}}\|^2 := \bar{\mu} \|x - x_{\text{proj}}\|^2\end{aligned}$$

故 $\langle \nabla f(x), x - x_{\text{proj}} \rangle \geq \bar{\mu} \|x - x_{\text{proj}}\|^2$ 。

5. 考虑凸函数 $f(x)$ 的共轭函数

$$f^*(y) = \sup_x (x^\top y - f(x))$$

证明:

(a). 若 $x \in \partial f(y)$, 则 $y \in \partial f^*(x)$;

(b). 若 $f(x)$ 是闭凸函数, 利用 $f = f^{**}$ 证明 $x \in \partial f(y)$ 等价于 $y \in \partial f^*(x)$ 。