Методы оптимизации. Семинар 8. Сопряженные функции.

Корнилов Никита Максимович

Московский физико-технический институт

23 октября 2025г

Сопряженная функция

Позволяет описывать функции с помощью максимального расстояния до прямой с углом наклона y.

Definition

Пусть $f : \mathbb{R}^n \to \overline{\mathbb{R}}$. Функция $f^* : \mathbb{R}^n \to \overline{\mathbb{R}}$

$$f^*(y) = \sup_{x\in\mathbb{R}^n} \{\underbrace{\langle x, y\rangle - f(x)}_{\text{вып по } y}\}$$

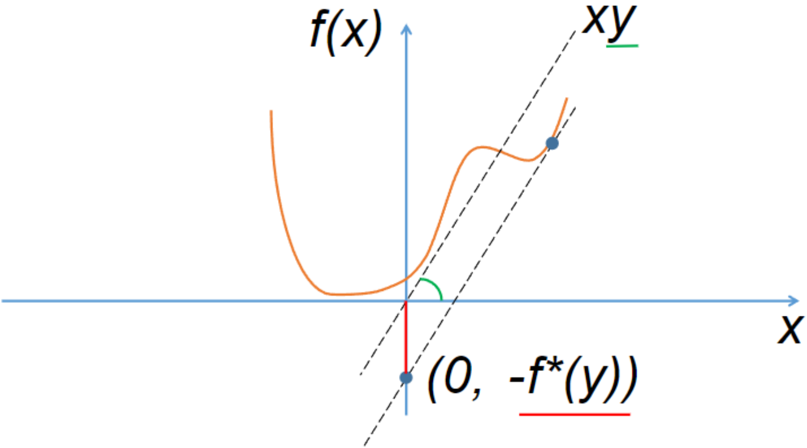
называется сопряженной по Фенхелю функцией к f.

для выпуклых

$f^{**} = f$

Сопряженная функция всегда выпуклая независимо от выпуклости f!

Геометрия сопряженной функции



Примеры сопряженных функций

Попробуем посчитать по определению $f^*(y)$. Если $f(x)$ - выпукла, то $\langle x, y\rangle - f(x)$ - вогнута по x, так что можно пользоваться критериями глобального максимума.

Example

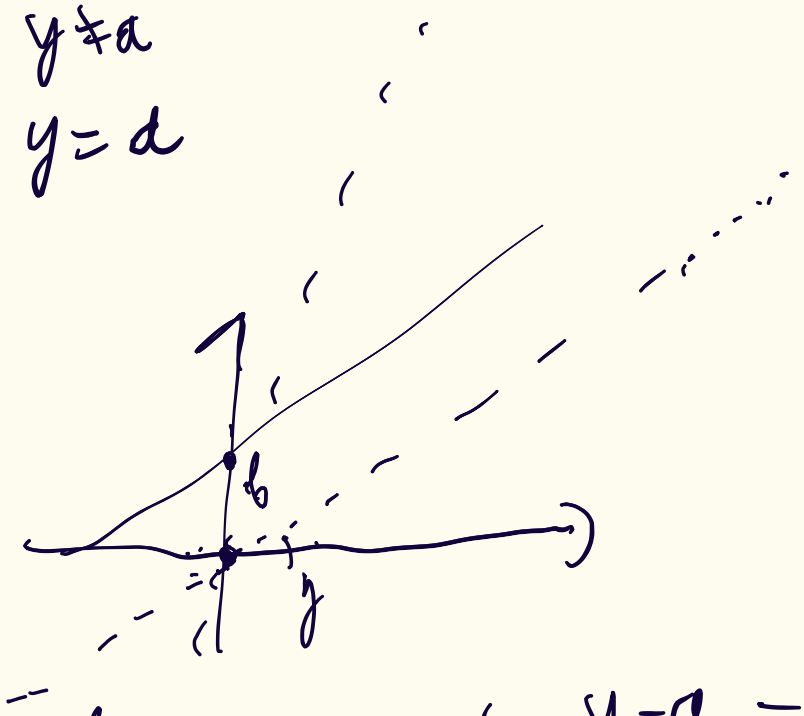
Найти сопряженную функцию к линейной функции $f(x) = \langle a, x\rangle + b$, где $a, x \in \mathbb{R}^n$ и $b \in \mathbb{R}$.

$$f^*(y) = \sup_x \{\langle x, y\rangle - \langle a, x\rangle - b\} = \sup_x \{\langle y-a, x\rangle - b\}$$

$$y - a \neq 0 \Rightarrow \sup = +\infty$$

$$y = a \Rightarrow \sup_x \{-b\} = -b$$

$$f^*(y) = \begin{cases} +\infty, & y \neq a \\ -b, & y = a \end{cases}$$



$g(x) = \langle y-a, x \rangle - b$

$\nabla g(x) = y - a = 0$

$\Downarrow$

$y = a$

1D сопряженные функции

Example

Найти сопряженную функцию к экспоненте $f(x) = e^x$, где $x \in \mathbb{R}$.

$f(x) = e^x$

$f^*(y) = \sup\limits_x (xy - e^x) = \sup\limits_x (g(x))$

$g'(x) = y - e^x$

Когда можно сделать $g'(x) = 0$

$\Updownarrow$

$y = e^x \quad y > 0 \Rightarrow \tilde{x} = \log y$ – точка max

$y > 0 \quad f^*(y) = \tilde{x} y - e^{\tilde{x}} = \underline{y \log y - y}.$

$y = 0 \Rightarrow \sup\limits_x \{-e^x\} = 0$

$e^x \in (0; +\infty)$

$y < 0 \quad \sup\limits_x \{xy - e^x\} \to +\infty$

$x \to -\infty \quad xy \to +\infty$

$e^x \to 0$

$$f^*(y) = \begin{cases} y \log y - y, & y > 0 \\ 0, & y = 0 \\ +\infty, & y < 0 \end{cases}$$

Общий алгоритм подсчета f^*

Для выпуклых и дифференцируемых функций:

1. Для каждого y посчитать градиент $\langle x, y\rangle - f(x)$ по x.
2. Посмотреть, для каких y градиент можно приравнять к 0 и найти глоб максимум по x.
3. Для остальных y надо смотреть, расходится ли супремум или сходится к конечному значения.

*Для субдифференцируемых функций можно считать субдифференциал для $\sup_x\{\langle x, y\rangle - f(x)\} = -\inf_x\{f(x) - \langle x, y\rangle\}$.
**Для сложно дифференцируемых функций, можно исследовать супремум по определению или свойствам сопряженных функций.

1D сопряженные функции

Example

Найти сопряженную функцию для $f(x) = \max\{1 - x, 0\}$, $x \in \mathbb{R}$.

$f(x) = \max\{1-x, 0\}$

$$f^*(y) = \sup_x \{xy - \max\{1-x, 0\}\} =$$

$-\max\{a,b\} = \min\{-a,-b\}$

$$= \sup_x \{\min\{x-1+xy,\ xy\}\}$$

$x-1+xy = xy \Rightarrow x=1$

$x>1 \Rightarrow \min\{\dots\} = xy$

$x \leq 1 \Rightarrow \min\{\dots\} = x-1+xy$

$x=1$

$\sup \neq +\infty \quad x(1+y)-1 \uparrow \Rightarrow \overbrace{(1+y) \geq 0}$

$xy \downarrow \qquad \boxed{y \leq 0}$

$y \in [-1;0] \Rightarrow f^*(y) = y$

$y \notin [-1;0] \quad f^*(y) = +\infty$

Example (Логистическая функция)

Найти сопряженную функцию для $f(x) = \log(1 + e^x)$, $x \in \mathbb{R}$.

$f(x) = \log(1+e^x)$

$f^*(y) = \sup_x \big(\underbrace{xy - \log(1+e^x)}_{g(x)} \big)$

$g'(x) = y - \frac{1}{1+e^x} e^x = y - \frac{e^x}{1+e^x}$

- $g'(x) = 0 \qquad y(1+e^x) = e^x$

$e^x = \frac{y}{1-y} \qquad y = \frac{y}{1-y}\left(1+\frac{y}{1-y}\right)$

$x = \log y - \log(1-y)$

$\frac{y}{1-y} > 0 \Rightarrow y \in (0;1)$

$f^*(y) = xy - \log(1+e^x) = y\log y - y\log(1-y)$

$\underbrace{- \log\left(1+\frac{y}{1-y}\right)}_{+\log(1-y)} = y\log y + (1-y)\log(1-y)$

- $y = 0 \qquad \sup_x \big(-\log(\underbrace{1+e^x}_{\to 1})\big) \overset{x\to-\infty}{=} 0$

- $y < 0 \qquad f^*(y) = \sup_x \big(xy - \log(1+e^x) \big) = +\infty$

$x \to -\infty \Rightarrow xy \to +\infty$

$\log(1+e^x) \to 0$

• $y=1$ $\quad \sup_x \{ x - \log(1+e^x) \}$

$$\log(1+e^x) = \log(e^x(e^{-x}+1)) = x + \log(1+e^{-x})$$

$$\sup_x \{ x - x - \log(1+e^{-x}) \} = \sup_x \{ -\log(\underbrace{1+e^{-x}}_{\geq 1}) \} \quad x \to +\infty = 0$$

• $y>1$

$$\sup_x \{ yx - x - \log(1+e^{-x}) \}$$

$$= \sup_x (\underbrace{(y-1)}_{>0} x - \log(1+e^{-x}) \} = +\infty$$

$x \to +\infty$

$(y-1)x \to +\infty$

$\log(1+e^{-x}) \to 0$

$$f^*(y) = \begin{cases} y\log y + (1-y)\log(1-y), & y \in [0;1] \\ +\infty & y \notin [0;1] \end{cases}$$

Example (Квадратичная функция)

Найти сопряженную функцию для $f(x) = \frac{1}{2}\langle x, Ax\rangle + \langle b, x\rangle$ для $A \in \mathbb{S}^n_{++}$ и $x, b \in \mathbb{R}^n$.

$$f(x) = \frac{\langle x, Ax\rangle}{2} + \langle b, x\rangle \qquad A \succ 0$$

$$f^*(y) = \sup_x \left\{ \langle x, y\rangle - \frac{\langle x, Ax\rangle}{2} - \langle b, x\rangle \right\}$$

$$= \sup_x \left\{ -\frac{\langle x, Ax\rangle}{2} + \langle y - b, x\rangle \right\}$$

$$\nabla g(\tilde{x}) = -A\tilde{x} + y - b = 0$$

$$\tilde{x} = -A^{-1}(b - y) \Leftarrow \forall A, b, y$$

$$f^*(y) = \langle \tilde{x}, y\rangle - \frac{\langle \tilde{x}, A\tilde{x}\rangle}{2} - \langle b, \tilde{x}\rangle$$

$$= -\frac{\langle A^{-1}(b-y), (b-y)\rangle}{2} + \langle b - y, A^{-1}(b-y)\rangle$$

$$= \frac{1}{2}\langle b - y, A^{-1}(b-y)\rangle, \ \forall y$$

Многомерные сопряженные функции

Example (Лог-детерминант)

Найти сопряженную функцию для $f(X) = -\log\det X$ на $X \in \mathbb{S}^n_{++}$.

$f(X) = -\log\det X$

$$f^*(Y) = \sup_X \{ \underbrace{\langle Y, X\rangle + \log\det X}_{g(X)} \}$$

$$dg(X) = \langle Y, dX\rangle + \frac{1}{\det X}\det X \langle X^{-1}, dX\rangle$$

$$= \langle Y + X^{-1}, dX\rangle \Rightarrow \nabla g(X) = Y + X^{-1}$$

- $\nabla g(X) = 0 \Rightarrow \tilde{X}^{-1} = -Y \Rightarrow \tilde{X} = -Y^{-1}$

$Y \prec 0 \Rightarrow \tilde{X} = -Y^{-1} \succ 0$

$$f^*(Y) = \langle \tilde{X}, Y\rangle + \log\det\tilde{X} =$$

$$= -\underbrace{\langle Y^{-1}, Y\rangle}_{n} + \log\det(-Y^{-1})$$

$\mathrm{Tr}(Y^{-1}Y) = \mathrm{Tr}(I)$

- $Y \nprec 0 \Rightarrow$ v – собств вектор с $\lambda \geq 0$

$$X_t = I + vv^T t, \quad t > 0$$

$$\sup\{\langle X_t, Y\rangle + \log\det X_t\} =$$

$$\sup\{\langle Y, I + vv^T t\rangle + \log\det(I + vv^T t)\}$$

$$= \sup\{\langle Y, I\rangle + \underbrace{\langle Y, vv^T t\rangle}_{\lambda t} + \log''(1 + t)\} \to +\infty$$

$\lambda > 0 \Rightarrow t \to +\infty$

$$\det(\underbrace{I + vv^T t}) = 1 + t$$

собственные числа

$$\underbrace{1, \dots, 1}_{n-1}, \ 1 + t$$

Example (Норма)

Найти сопряженную функцию для произвольной нормы $f(x) = \|x\|$ на $x \in \mathbb{R}^n$.

Переход от многомерных к 1D

Example

Найти сопряженную функцию для $f(x) = \frac{\|x\|^2}{2}$ на $x \in \mathbb{R}^n$.

- Пусть дан набор собственных функций $f_i : \mathbb{R}^n \to \overline{\mathbb{R}}, i \in \overline{1, m}$ с сопряженными функциями $f_i^*, i \in \overline{1, m}$. Тогда для функции $g : \mathbb{R}^n \times \dots \times \mathbb{R}^n \to \overline{\mathbb{R}}$, заданной по правилу

$$g(x_1, \dots, x_m) = \sum_{i=1}^{m} f_i(x_i),$$

сопряженная функция g^* считается как

$$g^*(y_1, \dots, y_m) = \sum_{i=1}^{n} f_i^*(y_i).$$

Example

Найдите сопряженную функцию к $f : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$

$$f(x) = \sum_{i=1}^{n} x_i \log x_i, \quad \mathrm{dom\ f} = \{x \in \mathbb{R}^n | x \geq 0\}.$$

- Пусть $f : \mathbb{R}^n \to \overline{\mathbb{R}}$ и $\alpha > 0$. Тогда для функций $g(x) = \alpha f(x)$ и $h(x) = \alpha f(\frac{x}{\alpha})$ сопряженные функции считаются как

$$g^*(y) = \alpha f^*(\frac{y}{\alpha}), \quad h^*(y) = \alpha f^*(y).$$

Example

Найти сопряженную функцию для $f(x) = \frac{\alpha\|x\|^2}{2}$ на $x \in \mathbb{R}^n$.

Дополнительные определения

Definition

Функция называется замкнутой, если её надграфик является замкнутым множеством.

Замкнутость функции равносильна её полунепрерывности снизу:

$$\underline{\lim}_{k\to\infty} f(x_k) \geq f(x_0)$$

для любых $x_k \to x_0$. Непрерывные функции, очевидно, являются полунепрерывными снизу.

Definition

Функция называется собственной, если она не принимает значение $-\infty$ ни в какой точке.

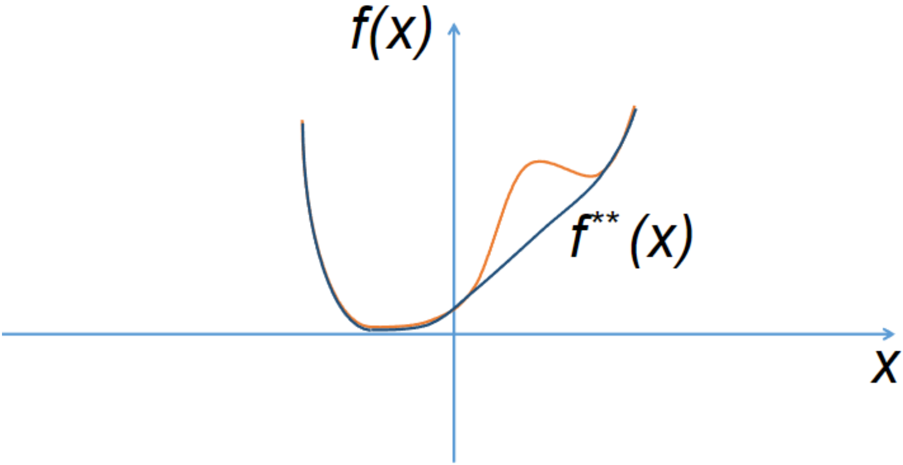
Свойства сопряженных функций

$$f^*(y) = \sup_{x \in \mathbb{R}^n} \{\langle x, y \rangle - f(x)\},$$

$$f^{**}(x) = \sup_{y \in \mathbb{R}^n} \{\langle x, y \rangle - f^*(y)\}.$$

- f^* замкнутая выпуклая функция.
- Функция $f^{**} = f$ если и только если f — выпуклая, замкнутая, собственная функция.
- Пусть f — замкнутая, собственная функция. Тогда следующие два утверждения равносильны при $\mu > 0$:
  1. f является μ-сильно выпуклой,
  2. f^* имеет $1/\mu$-липшицев градиент или f^* — $1/\mu$-гладкая.

Двойное сопряжение



Fenchel–Young inequality

- Пусть f — произвольная функция, тогда:

$$f(x) + f^*(y) \geq \langle x, y \rangle, \quad \forall x, y \in \mathbb{R}^n.$$

- Равенство достигается только и только если

$$f(x) + f^*(y) = \langle x, y \rangle \longleftrightarrow y \in \partial f(x).$$

- Следствие из Fenchel–Young

$$f(x) \geq f^{**}(x), \quad \forall x \in \mathbb{R}^n.$$

Example

Можно показать, что для $p > 1, \frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$ и $\forall x, y \in \mathbb{R}$ верно

$$\frac{|x|^p}{p} + \frac{|y|^q}{q} \geq xy.$$

Связь субдифференциала и сопряженных функций

Для выпуклых замкнутых функций субдифференциал имеет вид

$$\partial f(x) = \arg\max_y \{\langle x, y \rangle - f^*(y)\}.$$