Obsah

Ú	vod	2
Ι	Konvexní optimalizace	3
1	Základní geometrické pojmy	4
	1.1 Přímky a úsečky	4
	1.2 Affiní prostory	4
	1.3 Konvexní množiny	5
	1.4 Kužely	5
	1.5 Nadroviny a poloprostory	6
	1.6 Polyedry a polytopy	8
2	Lineární programování	10
	2.1 Formulace úlohy	10
	2.2 Dualita	11
	2.3 Komplementární skluzovost	12
3	Semidefinitní programování	14
4	Kuželové programování	15
II	Kombinatorické úlohy	16
5	Shannonova kapacita $5.1 \Theta(C_5) = \sqrt{5} $	17 18
6	Problém maximálníhu řezu	20
7	Problém obchodního cestujícího	21

OBSAH	
III Experimenty	22
8 Lovászova theta funkce	23
9 Problém maximálníhu řezu	24
Závěr	

$\acute{\mathbf{U}}\mathbf{vod}$

Část I Konvexní optimalizace

Kapitola 1

Základní geometrické pojmy

1.1 Přímky a úsečky

Mějme dva body $x_1, x_2 \in \mathbb{R}^n$ takové, že $x_1 \neq x_2$ a parametr $\theta \in \mathbb{R}^n$. Potom výraz

$$y = \theta x_1 + (1 - \theta)x_2 \tag{1.1}$$

popisuje **přímku** procházející body x_1 a x_2 . Pro $\theta = 0$ dostáváme bod x_2 a pro $\theta = 1$ bod x_1 . Omezíme-li θ na interval $\langle 0, 1 \rangle$, dostaneme **úsečku** s koncovými body x_1 a x_2 . Výraz 1.1 lze přepsat do tvaru

$$y = x_2 + \theta(x_1 - x_2),$$

který můžeme interpretovat jako součet počátečního bodu x_2 a nějakého násobku směrového vektoru $x_1 - x_2$.

1.2 Affiní prostory

Říkáme, že $C \subseteq \mathbb{R}^n$ je **afinní prostor**, jestliže přímka procházející libovolnými dvěma různými body z C leží v C. Tedy C obsahuje lineární kombinace libovolných dvou bodů z C, jestliže součet koeficientů lineární kombinace je roven jedné. To lze zobecnit i pro více než dva body. Lineární kombinace $\theta_1x_1+\cdots+\theta_kx_k$ bodů x_1,\ldots,x_k taková, že $\theta_1+\cdots+\theta_k=1$, se nazývá **afinní kombinace** bodů x_1,\ldots,x_k . Indukcí z definice afinního prostoru lze snadno ukázat, že pokud C je afinní množina, $x_1,\ldots,x_k\in C$ a $\theta_1+\cdots+\theta_k=1$, potom bod $\theta_1x_1+\cdots+\theta_kx_k\in C$.

Nechť C je afinní prostor a $x_0 \in C$, potom množina

$$V = C - x_0 = \{x - x_0 \mid c \in C\}$$

je **vektorový prostor**, tj. množina, která je uzavřená na sčítání a násobení skalárem.

Afinní prostor C lze vyjádřit jako

$$C = V + x_0 = \{v + x_0 \mid v \in V\},\$$

kde V je vektorový prostor a x_0 je počátek. Poznamenejme, že vektorový prostor V asociovaný s afinním prostorem C nezávisí na volbě počátku x_0 . **Dimenze** afinního prostoru $C = V + x_0$ je definována jako dimenze vektorového prostoru $V = C - x_0$, kde x_0 je libovolný prvek z C. Množina všech affiních kombinací bodů množiny $C \subseteq \mathbb{R}^n$ se nazývá **affiní obal** množiny C. Affiní obal množiny C budeme značit

aff
$$C = \{\theta_1 x_1 + \dots + \theta_k x_k \mid x_1, \dots, x_k \in C, \theta_1 + \dots + \theta_k = 1\}$$
.

Affiní obal je nejmenší affiní prostor, který obsahuje množinu C. Tedy, jestliže S je affiní prostor takový, že $C \subseteq S$, potom **aff** $C \subseteq S$.

1.3 Konvexní množiny

Říkáme, že množina C je **konvexní**, jestliže úsečka mezi libovolnými dvěma body z C leží také v C. Jinak řečeno, jestliže pro libovolné dva body $x_1, x_2 \in C$ a libovolné $\theta \in \langle 0, 1 \rangle$ platí, že $\theta x_1 + (1-\theta)x_2 \in C$. Poznamenejme, že každý afinní prostor je zároveň konvexní množinou. Podobně jako affiní kombinaci definujeme **konvexní kombinaci** bodů x_1, \ldots, x_k jako $\theta_1 x_1 + \cdots + \theta_k x_k$, kde $\theta_1 + \cdots + \theta_k = 1, \theta_i \geq 0$ pro $i = 1, \ldots, k$. **Konvexní obal** množiny C je množina všech konvexních kombinací bodů z množiny C, značíme

conv
$$C = \{\theta_1 x_1 + \dots + \theta_k x_k \mid x_i \in C, \theta_i \ge 0, i = 1, \dots, k, \theta_1 + \dots + \theta_k = 1\}.$$

Analogicky, konvexní obal množiny C je nejmenší konvexní množina, která obsahuje množinu C. Pro představu viz obrázek 1.1.

1.4 Kužely

Množina C se nazývá **kužel**, jestliže pro každé $x \in C$ a $\theta \geq 0$ platí, že $\theta x \in C$. Je-li C navíc konvexní, pak se C nazývá **konvexní kužel**. Tedy C je konvexní kužel, jestliže pro libovolné $x_1, x_2 \in C$ a $\theta_1, \theta_2 \geq 0$ platí, že $\theta_1 x_1 + \theta_2 x_2 \in C$. Říkáme, že bod ve tvaru $\theta_1 x_1 + \cdots + \theta_k x_k$, kde $\theta_1, \ldots, \theta_k \geq 0$ je **kuželovou kombinací** bodů x_1, \ldots, x_k . Dále, pokud x_i leží v konvexním kuželu množiny C, potom libovolná kuželová kombinace bodu x_i leží rovněž



(a) Množina bodů C



(b) conv C

Obrázek 1.1: Konvexní obal množiny

v konvexním kuželu množiny C. Platí, že množina C je konvexní kužel právě tehdy, když C obsahuje všechny kuželové kombinace svých bodů. **Kuželový obal** množiny C je množina, která obsahuje všechny kuželové kombinace množiny C, tj.

cone
$$C = \{\theta_1 x_1 + \dots + \theta_k x_k \mid x_i \in C, \theta_i > 0, i = 1, \dots, k\}.$$

Kuželový obal množiny C je zároveň nejmenší konvexní kužel, který obsahuje množinu C. Pro představu viz obrázek 1.2.

1.5 Nadroviny a poloprostory

Nadrovina je množina ve tvaru

$$\left\{x \mid a^T x = b\right\},\,$$

kde $a \in \mathbb{R}^n$, $a \neq 0$ a $b \in \mathbb{R}$. Analyticky se na nadrovinu koukáme jako na množinu všech řešení netriviální lineární rovnice. Geometricky zase jako na množinu všech bodů takových, že mají konstantní skalární součin s normálovým vektorem a. Konstanta b značí posunutí nadroviny od počátku. Nadrovinu také můžeme vyjádřit jako

$${x \mid a^T(x - x_0) = 0} = x_0 + {v \mid a^Tv = 0},$$



(a) Množina bodů C



Obrázek 1.2: Kuželový obal množiny

kde x_0 je libovolný bod této nadroviny a $\{v \mid a^T v = 0\}$ je množina všech vektorů, které jsou kolmé k normálovému vektorů a. Nadrovina je tedy množina, která obsahuje bod x_0 a libovolný bod ve tvarů $x_0 + v$, kde v je vektor, který je kolmý k normálovému vektorů a. Pro ilustraci v \mathbb{R}^2 viz obrázek 1.3a.

Nadrovina dělí \mathbb{R}^n na dva poloprostory. Množina

$$\{x \mid a^T x \le b\}$$
, resp. $\{x \mid a^T x < b\}$,

kde $a \neq 0$ se nazývá (uzavřený) **poloprostor**, resp. **otevřený poloprostor**. Je to tedy množina všech řešení netriviální lineární nerovnice. Podobně jako nadrovinu, můžeme poloprostor vyjádřit ve tvaru

$$\{x \mid a^T(x - x_0) \le 0\}, \text{ resp. } \{x \mid a^T(x - x_0) < 0\},$$

kde $a \neq 0$ a x_0 je libovolný bod z nadroviny $\{x \mid a^Tx = b\}$. Poloprostor tedy obsahuje bod x_0 a libovolný bod $x_0 + v$, kde v je vektor, který s vnějším normálovým vektorem svírá tupý nebo pravý úhel. Tato interpretace je v \mathbb{R}^2 ilustrována na obrázku 1.3b. Ještě poznamenejme, že poloprostory jsou konvexní množiny, ale samozřejmě nejsou affiní.



(b) Poloprostor

Obrázek 1.3: Nadrovina a poloprostor v \mathbb{R}^2 .

1.6 Polyedry a polytopy

Mějmě konečně mnoho uzavřených poloprostorů v \mathbb{R}^n . Množina, která vznikne jejich průnikem se nazývá **polytop**. Je-li navíc polytop omezený, potom ho nazýváme **polyedr**. Polyedr lze také ekvivalentně definovat jako konvexní obal konečně mnoha bodů v \mathbb{R}^n . Příkladem polyedrů v \mathbb{R}^3 jsou např. platónská tělesa, viz obrázek 1.4. Důležitý fakt říká Minkowského-Weyleova věta: každý polytop P je konečně generovaný a můžeme ho vyjadřit jako

$$P =$$
conv $(u_1, ..., u_r) +$ **cone** $(v_1, ..., v_s),$

kde u_i, v_i jsou extremální vrcholy P.



(a) Dodecahedron.



(b) Icosahedron.



(c) Octahedron.

Obrázek 1.4: Platónská tělesa.

Kapitola 2

Lineární programování

2.1 Formulace úlohy

Úlohou lineárního programování rozumíme minimalizaci nebo maximalizaci lineární **účelové funkce** vzhledem k lineárním **omezením**, kde tato omezení jsou dána soustavou lineární rovnic a nerovnic. Úlohu lineárního programování lze formulovat v několika ekvivalentních tvarech, které se liší zadáním omezení. Úloha v **kanonickém tvaru** má svá omezení dána soustavou lineárních nerovnic $Ax \leq b$. Tedy:

$$\max\left\{c^{T}x \mid Ax \le b, x \ge 0\right\},\tag{LP-P}$$

kde $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, $b \in \mathbb{R}^n$, $x \in \mathbb{R}^n$ a $c \in \mathbb{R}^n$. **Přípustná množina řešení** je průnikem poloprostorů, které jsou definovány soustavou nerovnic $Ax \leq b$ a **nezáporného ortantu**, tj. množiny $\{x \in \mathbb{R}^n \mid x_i \geq 0, i = 1, \dots, n\}$. Obě tyto množiny jsou konvexní a tedy i jejich průnik je rovněž konvexní množina. Dále, protože přípustnou množinu máme popsanou soustavou konečně mnoha lineárních nerovnic, geometricky se na úlohu LP-P můžeme koukat jako na maximalizaci lineární funkce přes polyedr, který je definován touto soustavou.

Příklad. Mějme následující úlohu:

$$\max x_1 + x_2
-x_1 + 3x_2 \le 4
4x_1 - x_2 \le 6
x > 0.$$
(P1)

Přípustná množina řešení je zobrazena na obrázku 2.1. Řešením úlohy je vektor $x^* = (2,2)$ s cenou 4. Implementace v softwaru MOSEK: https://github.com/c0n73x7/D1PL0MK4/blob/master/mosek/ex1.py.



Obrázek 2.1: Přípustná množina řešení k úloze P1.

2.2 Dualita

Úloha LP-P se nazývá **primární úloha**. Ke každé primární úloze můžeme přiřadit příslušnou **duální úlohu**. Je to opět úloha lineárního programování, která pro případ LP-P je ve tvaru:

$$\min \left\{ b^T y \mid A^T y \ge c, y \ge 0 \right\}. \tag{LP-D}$$

Příklad. Duální úloha k úloze P1 je ve tvaru:

$$\min 4y_1 + 6y_2
-y_1 + 4y_2 \ge 1
3y_1 - y_2 \ge 1
y \ge 0.$$
(P2)

Přípustná množina řešení je zobrazena na obrázku 2.2. Řešením úlohy je vektor $y^* \approx (0.4546, 0.3636)$ s cenou 4. Implementace v softwaru MOSEK: https://github.com/c0n73x7/D1PL0MK4/blob/master/mosek/ex2.py.

Všimněme si, že v příkladech P1 a P2 mají řešení x^* i y^* stejnou cenu. To není náhoda a tento fakt je obsahem silné věty o dualitě, kterou dokázala skupina kolem Alberta W. Tuckera v roce 1948. Začneme slabou větou o dualitě.

Věta 1 (Slabá o dualitě). Nechť \tilde{x} je přípustné řešení LP-P a \tilde{y} je přípustné řešení LP-D. Potom $c^T \tilde{x} \leq b^T \tilde{y}$.



Obrázek 2.2: Přípustná množina řešení k úloze P2.

Tedy každé přípustné řešení \tilde{y} duální úlohy LP-D nám dává horní odhad na maximum účelové funkce primární úlohy LP-P. Graficky můžeme slabou větu o dualitě interpretovat jako na obrázku 2.3. Zatím tedy nevíme, zda vždy existují přípustná (optimální) řešení x^* pro úlohu LP-P a y^* pro úlohu LP-D, pro která platí $c^Tx^*=b^Ty^*$. Kladnou odpověď dostaneme z již zmíněné silné věty od dualitě.



Obrázek 2.3: Slabá věta o dualitě.

Věta 2 (Silná o dualitě). *Jestliže úlohy LP-P a LP-D mají přípustná řešení.* Potom

$$\max \{c^T x \mid Ax \le b, x \ge 0\} = \min \{b^T y \mid A^T y \ge c, y \ge 0\}.$$

Se znalostí silné věty o dualitě můžeme obrázek 2.3 upravit na obrázek 2.4.

2.3 Komplementární skluzovost

Pro odvození tzv. podmínky komplementární skluzovosti nejprve převedeme úlohy LP-P a LP-D do jiných tvarů. V primární úloze povolíme $x \in \mathbb{R}^n$. Tedy



Obrázek 2.4: Ceny přípustných řešení primární a příslušné duální úlohy.

primární úloha je ve tvaru:

$$\max\left\{c^T x \mid Ax \le b\right\}. \tag{LP-P2}$$

A příslušná duální úloha je ve tvaru:

$$\min\left\{b^T y \mid A^T y = c, y \ge 0\right\}. \tag{LP-D2}$$

Nechť \tilde{x} je připustné řešení a x^* je optimální řešení úlohy LP-P2, \tilde{y} je přípustné řešení a y^* je optimální řešení úlohy LP-D2. **Dualitní rozdíl** \tilde{x} a \tilde{y} je číslo $b^T\tilde{y}-c^T\tilde{x}\geq 0$. Ze silné věty o dualitě samozřejmě plyne, že pro optimální řešení x^* a y^* je dualitní rozdíl roven 0. Vyjdeme z dualitního rozdílu optimálních řešení:

$$b^{T}y^{*} - c^{T}x^{*} = y^{*^{T}}b - y^{*^{T}}Ax^{*} = y^{*^{T}}(b - Ax^{*}) = 0.$$

Poslední rovnost přepíšeme maticově:

$$[y_1^*, \dots, y_m^*] \left(\begin{bmatrix} b_1 \\ \vdots \\ b_m \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ \vdots & & \vdots \\ a_{m1} & \dots & a_{mn} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1^* \\ \vdots \\ x_n^* \end{bmatrix} \right) = \begin{bmatrix} 0 \\ \vdots \\ 0 \end{bmatrix}.$$

Dostáváme tedy soustavu rovnic $y_i^* (b_i - a_i x^*) = 0$, kde i = 1, ..., m. Tedy buď $y_i^* = 0$ nebo $b_i - a_i x^* = 0$. Podmínka komplementární skluzovosti je splněna, jestliže pro přípustná řešení \tilde{x}, \tilde{y} platí buď $\tilde{y}_i = 0$ nebo $b_i - a_i \tilde{x} = 0$, i = 1, ..., m. Pokud nastane $b_i - a_i \tilde{x} = 0$, potom říkáme, že vazba $a_i \tilde{x} \leq b_i$ je aktivní.

Věta 3. Nechť \tilde{x} je přípustné řešení LP-P2 a \tilde{y} je přípustné řešení LP-D2. Potom \tilde{x}, \tilde{y} jsou optimální právě tehdy, když platí podmínka komplementární skluzovosti.

Kapitola 3 Semidefinitní programování

Kapitola 4 Kuželové programování

Část II Kombinatorické úlohy

Kapitola 5

Shannonova kapacita

Představme si zašuměný komunikační kanál, kterým posíláme zprávy, které jsou složeny ze symbolů (písmen) nějaké konečné abecedy. Vlivem šumu mohou být některé symboly špatně interpretovány a naším cílem je vybrat co největší počet slov délky k tak, aby žádná dvě slova nebyla vlivem šumu zaměnitelná.

Problém si formalizujeme v řeči teorie grafů. Mějme neorientovaný graf G=(V,E), kde množina vrcholů představuje symboly z konečné abecedy a dva vrcholy x,y jsou spojeny hranou, pokud vrchol x může být vlivem šumu zaměněn za y.

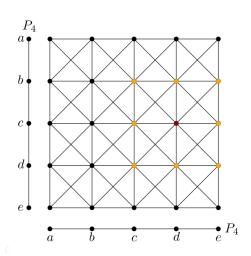
Maximální počet nezaměnitelných zpráv délky 1 je roven $\alpha(G)$, kde $\alpha(G)$ značí velikost největší nezávislé množiny v grafu G. Pro popis delších zpráv definujeme **silný součin** $G \cdot H$ grafů G a H následovně:

$$\begin{split} V(G \cdot H) &= V(G) \times V(H), \\ E(G \cdot H) &= \{(i, u)(j, v) \mid ij \in E(G) \wedge uv \in E(H)\} \cup \\ \{(i, u)(j, v) \mid ij \in E(G) \wedge u = v\} \cup \\ \{(i, u)(j, v) \mid i = j \wedge uv \in E(H)\} \,. \end{split}$$

Příklad. Pro graf $P_4 = a - b - c - d - e$ je silný součin $P_4 \cdot P_4$ zobrazen na obrázku 5.1. Z obrázku je hezky vidět, že např. zpráva cd (na obrázku červeně) může být zaměněna s bc, bd, be, cc, ce, dc, dd a de (na obrázku oranžově). Podobně pro další zprávy.

Pro jednoduchost budeme silný součin k kopií grafu G značit G^k . Tedy $\alpha(G^k)$ je maximální počet nezaměnitelných zpráv délky k. Shannonova kapacita grafu G je číslo

$$\Theta(G) = \lim_{k \to +\infty} \alpha(G^k)^{1/k}.$$



Obrázek 5.1: $P_4 \cdot P_4$

Neví se, zda pro libovolný graf G existuje vůběc nějaký algoritmus, kterým bychom určili hodnotu $\Theta(G)$. Přesto je alespoň něco známo. Pro perfektní grafy Claude E. Shannon ukázal, že $\Theta(G) = \alpha(G)$. To také znamená, že pro perfektní grafy lze $\Theta(G)$ určit v polynomiálním čase. Dalším kdo se problémem zabýval byl László Lovász, který velmi hezkým způsobem ukázal, že kružnice délky 5 má kapacitu $\sqrt{5}$. Na Lovászův postup se dále podíváme, protože vede k obecnému hornímu odhadu na $\Theta(G)$.

5.1
$$\Theta(C_5) = \sqrt{5}$$

Tenzorový součin vektorů $\mathbf{u} = (u_1, \dots, u_n)$ a $\mathbf{v} = (v_1, \dots, v_m)$ je

$$\mathbf{u} \circ \mathbf{v} = (u_1 v_1, \dots, u_1 v_m, u_2 v_1, \dots, u_n v_m).$$

Užitečné bude následující pozorování, které dává do souvisloti skalární a tenzorový součin.

Pozorování. Nechť **x**, **u** jsou vektory délky n a **y**, **v** jsou vektory délky m. Potom platí

$$(x \circ y)^{T} (u \circ v) = (x^{T}u) (y^{T}v).$$
(5.1)

Důkaz. Levá strana:

$$(x_1y_1, x_1y_2, \dots, x_1y_m, \dots, x_ny_m)^T (u_1v_1, u_1v_2, \dots, u_1v_m, \dots, u_nv_m) = x_1y_1u_1v_1 + x_1y_2u_1v_2 + \dots + x_1y_mu_1v_m + \dots + x_my_mu_nv_m$$

Pravá strana:

$$(x_1u_1 + \dots + x_nu_n) \cdot (y_1v_1 + \dots + y_nv_m) = x_1y_1u_1v_1 + x_1y_2u_1v_2 + \dots + x_1y_mu_1v_m + \dots + x_my_mu_nv_m$$

Mějme graf G=(V,E), kde $V=\{1,\ldots,n\}$. Systém $(\mathbf{v}_1,\ldots,\mathbf{v}_n)$ jednotkových vektorů v Euklidovském prostoru takový, že

$$\forall ij \notin E \implies \mathbf{v}_i \perp \mathbf{v}_j$$

nazýváme **ortonormální reprezentace** grafu G. Poznamenejme, že každý graf má nějakou ortonormální reprezentaci, např. $1 \mapsto \mathbf{e}_1, \dots, n \mapsto \mathbf{e}_n$.

Lemma 1. Nechť $(\mathbf{u}_1, \dots, \mathbf{u}_n)$ je ortonormální reprezentace grafu G a $(\mathbf{v}_1, \dots, \mathbf{v}_m)$ je ortonormální reprezentace grafu H. Potom $\mathbf{u}_i \circ \mathbf{v}_j$ je ortonormální reprezentace grafu $G \cdot H$.

Kapitola 6 Problém maximálníhu řezu

Kapitola 7

Problém obchodního cestujícího

Část III Experimenty

Kapitola 8 Lovászova theta funkce

Kapitola 9 Problém maximálníhu řezu

Závěr