

Note on (5)

$$P_{c/min} = -\frac{1}{2} [lb \ dl]^T \begin{bmatrix} A & C^T \\ c & 0 \end{bmatrix}^{-1} \begin{bmatrix} lb \\ dl \end{bmatrix}$$

$$= -\frac{1}{2} [lb \ dl]^T \begin{bmatrix} x \\ y \end{bmatrix}$$

$$= -\frac{1}{2} lb^T x - \frac{1}{2} dl^T y$$

$$= -\frac{1}{2} lb^T (A^{-1} lb - A^{-1} C^T y) - \frac{1}{2} dl^T y$$

$$= P_{min} + \frac{1}{2} y^T (C (A^{-1})^T lb - dl)$$

$$= P_{min} + \frac{1}{2} y^T (C A^{-1} lb - dl)$$