

$$\begin{aligned} \min & f(x_1, x_2) \\ \text{s.t.} & 4 - (x_1^2 + x_2^2) \geq 0 \end{aligned}$$

(1) 对于优化问题 $x_1 \geq 0$, $p = (-1, b)^T$ 是该问题在点 $(1, \sqrt{3})^T$ 处的可行方向, 则常数 b 的取值范围是 $b < 1/\sqrt{3}$ 。

解: 令 $x = (1, \sqrt{3})^T + \alpha(-1, b)^T = (1 - \alpha, \sqrt{3} + \alpha b)^T$, 在 $\alpha > 0$ 充分小时, x 是可行点。

$$\begin{aligned} 4 - (1 - \alpha)^2 - (\sqrt{3} + \alpha b)^2 &\geq 0 \\ \text{因此, } 1 - \alpha &\geq 0 \\ \alpha &\geq 0 \\ \sqrt{3} + \alpha b &\geq 0 \end{aligned}$$

后面三个不等式在 $\alpha > 0$ 充分小时显然成立。第一个不等式是:

$$2(1 - \sqrt{3}b)\alpha \geq \alpha^2(1 + b^2), \quad 2(1 - \sqrt{3}b) \geq \alpha(1 + b^2)$$

所以有 $1 - \sqrt{3}b > 0$, $b < \frac{1}{\sqrt{3}}$ 。

$$\begin{aligned} \max & -2x_1 + 3x_2 \\ \text{s.t.} & 4x_1 + x_2 \leq -4 \\ & -x_1 + 3x_2 \geq 1 \\ & x_1 \leq 0 \end{aligned}$$

(2) 向量 $(-1, r)^T$ 是问题在点 $(-1, 0)^T$ 的下降方向, 则 r 的范围是 $r < -2/3$ 。

解: 目标函数是 $-2x_1 + 3x_2$, $g = (-2, 3)^T$, $x = (-1, 0)^T$, $p = (-1, r)^T$

$$g^T p = 2 + 3r.$$

当 $2 + 3r < 0$ 时, 是下降方向, 当 $2 + 3r < 0$ 时, 是下降方向。

$$\text{当 } 2 + 3r = 0, \quad r = -\frac{2}{3},$$

$$x + \alpha p = (-1, 0)^T + \alpha(-1, -\frac{2}{3})^T = (-1 - \alpha, -\frac{2}{3}\alpha)^T$$

$$f(x + \alpha p) = -2(-1 - \alpha) + 3(-\frac{2}{3}\alpha) = 2 = f(x)$$

所以 $r = -\frac{2}{3}$ 时不是下降方向。

结论: $r < -\frac{2}{3}$ 时是下降方向。