

Regularitate și senzitivitate în optimizarea multicriterială

PN-II-ID-PCE-2011-3-0084, nr. 239/05.10.2011

În legătură cu obiectivele propuse pentru perioada ianuarie – decembrie 2014, în lucrarea [1] studiem o nouă metodă de a penaliza problemele de optimizare scalară vectorială, prin intermediul unei funcții cunoscută în literatură ca funcția timp minimal direcțională, ale cărei proprietăți au fost analizate în mod sistematic în lucrarea [7].

Merită menționat faptul că există deja două metode clasice de a penaliza problemele de optimizare. Dacă se notează cu M mulțimea punctelor admisibile (mulțimea restricțiilor), o primă metodă, directă, este așa-numita “penalizare infinită”, unde termenul de penalizare este dat de funcția indicator a mulțimii $M : i_M(x) = 0$ dacă $x \in M$ și $i_M(x) = \infty$, dacă $x \notin M$. Cealaltă metodă clasică de penalizare îi aparține lui Clarke (vezi [2, Proposition 2.4.3]) și folosește funcția distanță asociată mulțimii M . Această abordare a fost recent extinsă la optimizarea vectorială în [9]. Comparativ cu aceste două metode, termenul de penalizare propus de noi, dat de funcția timp minimal direcțională, este unul hibrid, deoarece în afara mulțimii M poate lua valori în $\mathbb{R} \cup \{+\infty\}$. Arătăm în lucrare că această funcție este potrivită pentru a penaliza principalele tipuri de probleme cu restricții geometrice: problemele scalare și vectoriale cu conuri de ordonare solide și nonsolide. De asemenea, folosim obiectele de diferențiere generalizată de tip Mordukhovich în formularea unor condiții necesare de optimalitate pentru punctele de minim Pareto asociate unei probleme unde funcția obiectiv este direcțional Lipschitz.

Prezentăm în continuare, pe scurt, principalele rezultate. Reamintim că, dacă X este un spațiu liniar normat, $u \in X \setminus \{0\}$ este un element, iar $\emptyset \neq M \subset X$ este o mulțime închisă, definim funcția timp minimal direcțională prin $T_u(\cdot, M) : X \rightarrow [0, \infty]$,

$$T_u(x, M) := \inf\{t \geq 0 \mid x + tu \in M\}, \quad (1)$$

cu convenția $\inf \emptyset = +\infty$.

Fie problema de optimizare scalară

$$(P_s) \quad \min s(x) \text{ a.î. } x \in M,$$

unde $s : X \rightarrow \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$.

Următoarea teoremă arată că funcția $T_u(\cdot, M)$ furnizează un termen exact de penalizare pentru (P_s) .

Teorema 1 *Presupunem că $s : X \rightarrow \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$ este local Lipschitz în jurul lui \bar{x} relativ la domeniul său cu constanta $L > 0$ și $\bar{x} \in M \cap \text{dom } s$ este o soluție locală pentru (P_s) . Atunci pentru orice $u \in X \setminus \{0\}$, \bar{x} este un minim local (fără restricții) al funcției $s + L\|u\|T_u(\cdot, M)$.*

Trecând la cazul vectorial, considerăm Y , un spațiu liniar normat, parțial ordonat de un con convex, închis, propriu și punctat K . Pentru a acoperi cât mai multe situații, facem câteva convenții naturale legate de multiplicarea între $\pm\infty$ și elementele nenule din K . În plus, deoarece dorim să acoperim cazul funcțiilor cu valori reale extinse, îi adăugăm lui Y două elemente abstracte și distincte $-\infty_K, +\infty_K$, care nu sunt din Y , și notăm $\bar{Y} := Y \cup \{-\infty_K, +\infty_K\}$. Regulile de ordine și algebrice de care avem nevoie pentru aceste două elemente sunt cele uzuale.

Fie funcția $v : X \rightarrow Y \cup \{+\infty_K\}$ și $M \subset \text{dom } v := \{x \in X \mid v(x) \in Y\}$ o mulțime închisă. Atunci considerăm problema generală de optimizare vectorială

$$(P_v) \quad \min v(x) \text{ a.î. } x \in M,$$

unde minimul este luat în sensul clasic (slab sau tare) Pareto. Reamintim că un punct admisibil \bar{x} se numește minim local slab Pareto pentru (P_v) dacă $\text{int } K \neq \emptyset$ și există o vecinătate V a lui \bar{x} a.î. pentru orice punct admisibil x din V , are loc $v(x) - v(\bar{x}) \notin -\text{int } K$. De asemenea, un punct admisibil \bar{x} se numește minim local Pareto pentru (P_v) dacă există o vecinătate V a lui \bar{x} a.î. pentru orice punct admisibil x din V , are loc $v(x) - v(\bar{x}) \notin -K \setminus \{0\}$ (această ultimă noțiune operează și în cazul în care $\text{int } K = \emptyset$). În variantele globale ale definițiilor de mai sus se înlocuiește V cu X .

De asemenea, spunem că v este K -Lipschitz de rang $L > 0$ pe o mulțime $S \subset X$ dacă există un element $e \in K \setminus \{0\}$ astfel încât pentru orice $x', x'' \in S$

$$v(x'') + L \|x'' - x'\| e - v(x') \in K.$$

Au loc următoarele rezultate.

Teorema 2 În notațiile de mai sus, presupunem că v este K -Lipschitz de rang $L > 0$ pe X și fie $e \in K \setminus \{0\}$ elementul dat de această condiție. Fie $u \in X \setminus \{0\}$.

(i) Dacă $\bar{x} \in M$ este un minim local slab Pareto pentru (P_v) , atunci este un minim local slab Pareto (fără restricții) pentru funcția $v(\cdot) + L \|u\| T_u(\cdot, M)e$.

(ii) Dacă $\bar{x} \in M$ este un minim global slab Pareto pentru (P_v) , atunci este un minim global slab Pareto (fără restricții) pentru funcția $v(\cdot) + L \|u\| T_u(\cdot, M)e$.

Teorema 3 În notațiile de mai sus, presupunem că v este K -Lipschitz de rang $L > 0$ pe X și fie $e \in K \setminus \{0\}$ elementul dat de această condiție. Fie $u \in X \setminus \{0\}$.

(i) Dacă $\bar{x} \in M$ este un minim local Pareto pentru (P_v) , atunci este un minim local Pareto (fără restricții) pentru funcția $v(\cdot) + L' \|u\| T_u(\cdot, M)e$ pentru orice $L' > L$.

(ii) Dacă $\bar{x} \in M$ este un minim global Pareto pentru (P_v) , atunci este un minim global Pareto (fără restricții) pentru funcția $v(\cdot) + L' \|u\| T_u(\cdot, M)e$ pentru orice $L' > L$.

Pentru formularea condițiilor necesare de optimalitate, folosim, după cum am menționat mai sus, obiecte de diferențiere generalizată de tip Mordukhovich. De asemenea, exploatăm un principiu ce asertează incompatibilitatea dintre optimalitate și deschiderea unei multifuncții de tip epigraf asociată unei probleme de optimizare vectorială (vezi [3]), precum și o teoremă ce conține condiții suficiente în termenii coderivatelor Fréchet pentru deschiderea liniară a sumei a două multifuncții (vezi [4]).

Principalul rezultat legat de condiții de optimalitate în cazul problemelor vectoriale cu restricții geometrice este prezentat în continuare. O mulțime $M \subset X$ se numește epi-Lipschitz în $\bar{x} \in X$ în direcția $u \neq 0$ dacă există $\delta > 0$ astfel încât pentru orice $\omega \in M \cap B(\bar{x}, \delta)$, $z \in B(u, \delta)$ și $\lambda \in [0, \delta]$, are loc $\omega + \lambda z \in M$.

Teorema 4 Fie X și Y spații Asplund. Considerăm problema (P_v) și presupunem că $\bar{x} \in M$ este un minim Pareto local pentru (P_v) . De asemenea, presupunem că:

(i) v este K -Lipschitz de rang $L > 0$ pe X , iar $e \in K \setminus \{0\}$ este elementul dat de această condiție Lipschitz;

(ii) există un $u \in X \setminus \{0\}$ astfel încât M este epi-Lipschitz în \bar{x} în direcția u ;

(iii) K este (SNC) în 0

Atunci pentru orice $L' > L$, există $y^* \in K^* \setminus \{0\}$ și $x^* \in D^*v(\bar{x})(y^*)$ astfel încât

$$-x^* \in N(M, \bar{x}),$$

și

$$x^*(u) \leq L' \|u\| y^*(e).$$

În lucrarea [10], pe lângă alte rezultate, punem în evidență și utilizarea quasi-interiorului (relativ) al unei mulțimi convexe în obținerea unor condiții de optimalitate și dualitate în optimizarea vectorială. Începem prin a aminti câteva noțiuni de eficiență (minimalitate) în raport cu ordinea indusă de un con convex punctat $C \subset Y$, unde Y este un spațiu local convex. Fie $\emptyset \neq E \subset Y$; considerăm mulțimile

$$\begin{aligned} \text{Min}(E, C) &:= \{a \in E \mid (E - a) \cap (-C) = \{0\}\}, \\ \text{WMin}(E, C) &:= \{a \in E \mid (E - a) \cap (-\text{int } C) = \emptyset\} \quad (\text{când } \text{int } C \neq \emptyset), \\ \text{BMin}(E, C) &:= \{a \in E \mid \text{cl}(\mathbb{R}_+(E + C - a)) \cap (-C) = \{0\}\}, \\ \text{QMin}(E, C) &:= \{a \in E \mid (E - a) \cap (-\text{qri } C) = \emptyset\} \quad (\text{când } \text{qri } C \neq \emptyset). \end{aligned}$$

Amintim că pentru o mulțime convexă nevidă $A \subset Y$, $\text{qri } A := \{a \in A \mid \text{cl}(\mathbb{R}_+(A - a)) \text{ este spațiu liniar}\}$, iar $\text{qi } A := \{a \in A \mid \text{cl}(\mathbb{R}_+(A - a)) = Y\}$. Când C are o bază B , adică $B \subset C$ este o mulțime convexă astfel încât $0 \notin \text{cl } B$ și $C = \mathbb{R}_+ B$, definim

$$\text{HMin}(E, B) := \cup \{\text{Min}(E, \mathbb{R}_+(B + U)) \mid U \in \mathcal{N}_Y^c, (2U) \cap B = \emptyset\},$$

unde \mathcal{N}_Y^c este clasa vecinătăților deschise, convexe și simetrice ale lui $0 \in Y$; este clar că pentru $U \in \mathcal{N}_Y^c$ cu $(2U) \cap B = \emptyset$ avem că $Q := \mathbb{R}_+(B + U)$ este un con convex punctat cu $\text{int } Q = \mathbb{P}(B + U)$. Este (aproape) evident că $\text{HMin}(E, B) \subset \text{Min}(E, C)$.

Dacă $\text{int } C \neq \emptyset$ atunci $\text{Min}(E, C) \subset \text{WMin}(E, C) = \text{QMin}(E, C)$. Presupunând că $0 \notin \text{qri } C \neq \emptyset$, avem că $\text{Min}(E, C) \subset \text{QMin}(E, C)$; totuși, dacă $0 \in \text{qri } C$ atunci $\text{qri } C = C$ și $\text{QMin}(E, C) = \emptyset$. De fapt $0 \in \text{qri } C \Leftrightarrow 0 \in \text{qri}(\text{cl } C) \Leftrightarrow \text{cl } C$ este spațiu liniar $\Leftrightarrow C^+$ este a spațiu liniar (și $0 \in \text{qi } C \Leftrightarrow \text{cl } C = X \Leftrightarrow C^+ = \{0\}$). Luând în considerare observațiile precedente, în cele ce urmează presupunem că $0 \notin \text{qri } C$. În plus, este evident că $\text{BMin}(E, C) \subset \text{Min}(E, C)$.

După cum se știe, $\text{Max}(E, C) := \text{Min}(E, -C)$, și similar pentru celelalte noțiuni Max.

Considerăm acum $F : S \rightrightarrows Y$ și $G : S \rightrightarrows Z$ două multifuncții cu $\emptyset \neq S = \text{dom } F = \text{dom } G$, unde Y, Z sunt spații local convexe separate Hausdorff, ordonate de conurile convexe C , respectiv K . Considerăm problema de minimizare

$$(VP) \ C\text{-min}_{x \in M} F(x),$$

unde $M := \{x \in S \mid G(x) \cap (-K) \neq \emptyset\}$; desigur, $G(x) \cap (-K) \neq \emptyset \Leftrightarrow 0 \in G(x) + K$.

Fie $x_0 \in M$ și $y_0 \in F(x_0)$. Spunem că (x_0, y_0) este soluție (resp. soluție slabă, quasi-slabă) a lui (VP) dacă $y_0 \in \text{Min}(F(M), C)$ (resp. $y_0 \in \text{WMin}(F(M), C)$, $y_0 \in \text{QMin}(F(M), C)$). Noțiunea de soluție quasi-slabă a fost introdusă în [8, Def. 2.17] (cu același nume) în cazul în care $\text{qi } C \neq \emptyset$ și în [11].

În spiritul tezei lui T.N. Tasset [8], considerăm mulțimea

$$\mathcal{E} := (F \times G)(S) + C \times K,$$

unde $F \times G : S \rightrightarrows Y \times Z$, $(F \times G)(x) := F(x) \times G(x)$ pentru $x \in S$. Desigur, $F \times G$ este convexlike atunci când \mathcal{E} este convexe. Deoarece $G(S) + K = \text{Pr}_Z(\mathcal{E})$, $G(S) + K$ este convexe dacă \mathcal{E} este convexe. Observăm că $F \times G$ este $C \times K$ -convexă (și deci \mathcal{E} este convexe) atunci când S este o submulțime convexe a unui spațiu liniar, F este C -convexă și G este K -convexă.

Rezultatul următor corespunde celui din [8, Th. 3.3].

Propoziția 5 Fie $F \times G$ convexlike. Presupunem că (a) $x_0 \in M$ și $y_0 \in F(x_0)$, (b) $(y_0, 0) \notin \text{qi } \mathcal{E}$ și (c) $0 \in \text{qi}(G(S) + K)$. Atunci (d) există $y^* \in C^+ \setminus \{0\}$ și $z^* \in K^+$ astfel încât $\langle y, y^* \rangle + \langle z, z^* \rangle \geq \langle y_0, y^* \rangle$ pentru orice $(y, z) \in (F \times G)(S)$.

Invers, presupunem că (a) și (d) sunt verificate. Atunci au loc (b) și (e) $z^*(G(x_0) \cap (-K)) = \{0\}$; în plus, dacă $\text{qi } C \neq \emptyset$ atunci au loc (b') $(y_0, 0) \notin \text{qri } \mathcal{E}$ și (f) $y_0 \in \text{QMin}(F(M), C)$, adică (x_0, y_0) este o soluție quasi-slabă pentru (VP).

Condition (c) în Propoziția 5 este mai slabă, atunci când G este convexlike, decât condiția de tip Slater (c') $G(\bar{x}) \cap (-\text{qi } K) \neq \emptyset$ pentru un $\bar{x} \in S$; într-adevăr, $G(S) + K$ fiind convexe,

$$0 \in G(\bar{x}) + \text{qi } K \subset (G(S) + K) + \text{qi } K \subset \text{qi}(G(S) + K + K) = \text{qi}(G(S) + K).$$

Observația 6 Teorema 3.3 din [8] stabilește că (a) \wedge (b') \wedge (c) \Rightarrow (d) \wedge (e) atunci când F este C -convexă, G este K -convexă și $\text{qi } C \neq \emptyset$; [8, Cor. 3.4] este [8, Th. 3.3] în care (c) este înlocuit prin (c'). Notăm de asemenea că în cazul în care $\text{qi } C \neq \emptyset$ și $\text{qi } K \neq \emptyset$ avem că $\text{aff } \mathcal{E} = Y \times Z$, și astfel $\text{qri } \mathcal{E} = \text{qi } \mathcal{E}$.

Rezultatul următor corespunde celui din [8, Th. 3.7]; aici $L^+(Z, Y) := \{T \in L(Z, Y) \mid T(K) \subset C\}$.

Propoziția 7 Fie $F \times G$ convexlike și fie $\text{qi } C \neq \emptyset$. Presupunem că (a) și (d) din Propoziția 5 au loc. Atunci există $T \in L^+(Z, Y)$ astfel încât $y_0 \in \text{QMin}((F + T \circ G)(S), C)$ și $T(G(x_0) \cap (-K)) = \{0\}$.

Observația 8 Teorema 3.7 din [8] stabilește că are loc concluzia Propoziției 7 atunci când F este C -convexă, G este K -convexă, $\text{qi } C \neq \emptyset$ și (a), (f), (b'), (c) sunt verificate; după cum se vede din Propoziția 5, condiția (f) poate fi transferată de la ipoteză la concluzia Teoremei 3.7 din [8].

Ca în [8], problemei (VP) îi asociem multifuncția Lagrange

$$\mathcal{L} : S \times L^+ \rightrightarrows Y, \quad \mathcal{L}(x, T) := F(x) + T(G(x)),$$

unde $L^+ := L^+(Z, Y)$, și multifuncția obiectiv duală

$$\Psi : L^+ \rightrightarrows Y, \quad \Psi(T) := \text{QMin}(L(\cdot, T)(S), C).$$

Corolarul 9 Fie $F \times G$ convexlike și fie $\text{qi } C \neq \emptyset$. Presupunem că (a), (b) și (c) din Propoziția 5 sunt îndeplinite. Atunci

$$y_0 \in \text{QMin}(F(M), C) \cap \text{QMax}(\Psi(L^+), C).$$

Observația 10 Teorema 3.10 din [8] stabilește că $y_0 \in \text{QMin}(F(M), C)$ dacă și numai dacă $y_0 \in \text{QMax}(\Psi(L^+), C)$ atunci când F este C -convexă, G este K -convexă, $\text{qi } C \neq \emptyset$ și (a), (b'), (c) sunt verificate; concluzia Teoremei 3.10 din [8] este mult mai slabă decât cea a Corolarului 9. Observăm de asemenea că concluzia $\bar{y} \in \text{QMin}(F(x_0), C)$ a Teoremei 3.9 din [8] (pentru $x_0 \in M$ și $\bar{y} \in \Psi(L^+)$) nu este corectă deoarece \bar{y} nu este în mod necesar în $F(x_0)$; relația corectă de dualitate slabă este

$$(F(M) - \psi(L^+)) \cap (-\text{qi } C) = \emptyset.$$

Rezultatele menționate mai sus pot fi utilizate pentru studierea punctelor eficiente în sens Henig, adică elementele mulțimii $\text{HMin}(F(M), B)$, în cazul în care B este o bază a lui C . În această situație luând $C_U^B := \mathbb{R}_+(B + U)$ cu $U \in \mathcal{N}_C^{\neq}$, $(2U) \cap B = \emptyset$, avem că $\text{qi } C_U^B = \text{int } C_U^B = C_U^B \setminus \{0\}$ și

$$(C_U^B)^+ = \{y^* \in Y^* \mid \inf y^*(B) \geq 2 \sup y^*(U)\} \subset \{0\} \cup C_B^\Delta,$$

unde

$$C_B^\Delta := \{y^* \in Y^* \mid \inf y^*(B) > 0\} \subset C^\#.$$

Fie

$$\mathcal{E}_U^B := (F \times G)(S) + C_U^B \times K.$$

Deoarece $C \times K \subset C_U^B \times K$, $F \times G$ este $C_U^B \times K$ -convexlike dacă $F \times G$ este $C \times K$ -convexlike.

Rezultatul următor corespunde celui din [8, Th. 4.3].

Propoziția 11 Fie $F \times G$ $C \times K$ -convexlike și B o bază a lui C . Presupunem că (a) $x_0 \in M$ și $y_0 \in F(x_0)$, (b) există $U \in \mathcal{N}_C^{\neq}$ astfel încât $(2U) \cap B = \emptyset$ și $(y_0, 0) \notin \text{qi } \mathcal{E}_U^B$, (c) $0 \in \text{qi}(G(S) + K)$. Atunci (d) există $y^* \in C_B^\Delta$ și $z^* \in K^+$ astfel încât $\langle y, y^* \rangle + \langle z, z^* \rangle \geq \langle y_0, y^* \rangle$ pentru orice $(y, z) \in (F \times G)(S)$.

Invers, presupunem că (a) și (d) sunt verificate. Atunci au loc următoarele: (b') (adică condiția (b) cu qi înlocuit prin qri), (e) $z^*(G(x_0) \cap (-K)) = \{0\}$ și (f) $y_0 \in \text{HMin}(F(M), B)$.

Observația 12 Teorema 4.3 din [8] stabilește că (a) \wedge (f) \wedge (b') \wedge (c) \Rightarrow (d) \wedge (e) și (a) \wedge (d) \wedge (e) \Rightarrow (b') \wedge (f) atunci când F este C -convexă, G este K -convexă și B este o bază a lui C . Să observăm că (practic) singura diferență dintre [8, Th. 4.3] și [5, Th. 3.1] este că condiția (b') de mai sus este înlocuită printr-o altă condiție (b) (mai complicată); de fapt, în ipoteza că condițiile (a) și (c) de mai sus sunt îndeplinite, condițiile (b), (b') și (b) din [5, Th. 3.1] sunt echivalente.

Se poate arăta că mai multe rezultate din [11] se pot obține în condiții mult mai slabe, dar nu mai dăm detalii aici.

Bibliografie

- [1] M. Apetrii, M. Durea, R. Strugariu, *A new penalization tool in scalar and vector optimizations*, *Nonlinear Analysis*, 107 (2014), 22–33.
- [2] F. H. Clarke, *Optimization and nonsmooth analysis*, Wiley, New York, 1983.
- [3] M. Durea, R. Strugariu, *On some Fermat rules for set-valued optimization problems*, *Optimization*, 60 (2011), 575–591.
- [4] M. Durea, R. Strugariu, *Openness stability and implicit multifunction theorems: Applications to variational systems*, *Nonlinear Analysis: Theory, Methods and Applications*, 75 (2012), 1246–1259.
- [5] X.H. Gong, *Optimality conditions for Henig and globally proper efficient solutions with ordering cone has empty interior*, *J. Math. Anal. Appl.*, 307 (2005), 12–31.
- [6] B. S. Mordukhovich, *Variational Analysis and Generalized Differentiation*, Vol. I: Basic Theory, Vol. II: Applications, A Series of Comprehensive Studies in Mathematics, Vol. 330 and 331, Berlin, 2006.

- [7] N. M. Nam, C. Zălinescu, *Variational analysis of directional minimal time functions and applications to location problems*, Set-Valued Var. Anal., 21 (2013), 405–430.
- [8] T.N. Tasset, *Lagrange multipliers for set-valued functions when ordering cones have empty interior*, ProQuest LLC, Ann Arbor, MI (2010), thesis (Ph.D.)—University of Colorado at Boulder.
- [9] J. J. Ye, *The exact penalty principle*, Nonlinear Analysis: Theory Methods and Applications, 75 (2012), 1642–1654.
- [10] C. Zălinescu, *On the use of the quasi-relative interior in optimization*, 2014 (trimisă spre publicare).
- [11] Z.A. Zhou, X.M. Yang, *Optimality conditions of generalized subconvexlike set-valued optimization problems based on the quasi-relative interior*, J. Optim. Theory Appl, 150 (2011), 327–340.

Director de proiect,
prof. dr. Constantin Zălinescu