

**Индивидуальное ДЗ по курсу «Методы оптимизации»
Выполнил студент группы М8О-300Б Иванов И.И.
Вариант №1**

$$f(X) = x_1^2 + 2x_2^2 - 2x_1 - 6x_2 - 12 \rightarrow \text{extr}$$

$$2x_1 + x_2 = -1$$

Этап №1. Тема: Методы решения ЗНП при ограничениях типа равенства

Задание:

- а) Решить задачу графически.
- б) Аналитически отыскать экстремум функции при ограничениях типа равенства, используя аппарат необходимых и достаточных условий (методом множителей Лагранжа).
- в) Найти решение задачи методом штрафной функции.

**1. МЕТОДЫ РЕШЕНИЯ ЗАДАЧИ НЕЛИНЕЙНОГО ПРОГРАММИРОВАНИЯ
ПРИ ОГРАНИЧЕНИЯХ ТИПА РАВЕНСТВА**

Задание 1а).

Дано: $f(X) = x_1^2 + 2x_2^2 - 2x_1 - 6x_2 - 12 \rightarrow \text{extr}$

$$2x_1 + x_2 = -1$$

Преобразуем ограничение к виду: $\varphi_1(X) = 0$

$$2x_1 + x_2 = -1 \Rightarrow 2x_1 + x_2 + 1 = 0 \Rightarrow \varphi_1(X) = 2x_1 + x_2 + 1$$

Решить задачу графически.

Решение:

Решение задачи есть точка касания ограничения и линии уровня функции $f = C$, где $C = \text{const}$. Искомая точка касания обладает следующими свойствами:

- точка касания принадлежит ограничению: $2x_1^{\text{Кас}} + x_2^{\text{Кас}} = -1$
- в точке касания градиенты функции и ограничения линейно зависимы:

$$\nabla f(X^{\text{Кас}}) = \alpha \cdot \nabla \varphi_1(X^{\text{Кас}}) \Rightarrow \begin{pmatrix} 2x_1^{\text{Кас}} - 2 \\ 4x_2^{\text{Кас}} - 6 \end{pmatrix} = \alpha \cdot \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix} \Rightarrow \frac{2x_1^{\text{Кас}} - 2}{2} = \frac{4x_2^{\text{Кас}} - 6}{1}$$

Воспользовавшись условиями касания, составим систему уравнений и найдем координаты решения:

$$\begin{cases} 2x_1 + x_2 = -1 \\ x_1 - 1 = 4x_2 - 6 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} 2x_1 + x_2 = -1 \\ x_1 - 4x_2 = -5 \end{cases} \quad (1) \xrightarrow{-2 \cdot (2)} (2) \quad \begin{cases} 2x_1 + x_2 = -1 \\ 9x_2 = 9 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} x_1^* = -1 \\ x_2^* = 1 \end{cases}$$

Найдена точка $X^* = (-1, 1)^T$ – точка касания ограничения и линии уровня функции.

Построим графическую иллюстрацию решения.

Ограничение в задаче – прямая с уравнением $2x_1 + x_2 = -1$, она проходит через точки:

x_1	x_2
0	-1
-0.5	0

Построим прямую на графике и обозначим $\varphi_1(X) = 0$.

Найдём значение функции в найденной точке касания $X^* = (-1, 1)^T$:

$$f = (-1)^2 + 2 \cdot 1^2 - 2 \cdot (-1) - 6 \cdot 1 - 12 = -13$$

Определим конфигурацию линии уровня функции, вычислив инвариант:

$$D = \begin{vmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 2 \end{vmatrix} = 2 \quad \text{т.к. } D > 0, \text{ то искомая линия уровня эллипс.}$$

Запишем уравнение линии уровня:

$$x_1^2 + 2x_2^2 - 2x_1 - 6x_2 - 12 = -13$$

$$x_1^2 + 2x_2^2 - 2x_1 - 6x_2 = -1$$

Приведем уравнение линии уровня к каноническому виду, выделив полные квадраты:

$$x_1^2 - 2x_1 + 2(x_2^2 - 3x_2) = -1$$

$$\underbrace{x_1^2 - 2x_1 + 1}_{(x_1-1)^2} - 1 + 2 \underbrace{(x_2^2 - 2 \cdot \frac{3}{2}x_2 + \frac{9}{4} - \frac{9}{4})}_{(x_2 - \frac{3}{2})^2 - \frac{9}{4}} = -1$$

$$(x_1 - 1)^2 - 1 + 2((x_2 - \frac{3}{2})^2 - \frac{9}{4}) = -1$$

$$(x_1 - 1)^2 + 2(x_2 - \frac{3}{2})^2 = -1 + 1 + \frac{9}{2}$$

$$\boxed{\frac{(x_1 - 1)^2}{\frac{9}{2}} + \frac{(x_2 - \frac{3}{2})^2}{\frac{9}{4}} = 1} \text{ – каноническое уравнение эллипса}$$

Центр эллипса – точка с координатами $(1, \frac{3}{2})$.

Главные диагонали эллипса прямые с уравнениями: $x_1 = 1$ и $x_2 = \frac{3}{2}$.

Найдём точки пересечения эллипса с главными диагоналями:

$$x_1 = 1 \Rightarrow \frac{(x_2 - \frac{3}{2})^2}{\frac{9}{4}} = 1 \Rightarrow (x_2 - \frac{3}{2})^2 = \frac{9}{4} \Rightarrow x_2 - \frac{3}{2} = \pm \frac{3}{2} \Rightarrow \begin{matrix} x_2 = 3 \\ x_2 = 0 \end{matrix}$$

Получены точки с координатами: $(1, 0)$ и $(1, 3)$

$$x_2 = \frac{3}{2} \Rightarrow \frac{(x_1 - 1)^2}{\frac{9}{2}} = 1 \Rightarrow (x_1 - 1)^2 = \frac{9}{2} \Rightarrow x_1 - 1 = \pm \frac{3}{\sqrt{2}} \Rightarrow \begin{matrix} x_2 = 3.1213 \\ x_1 = -1.1213 \end{matrix}$$

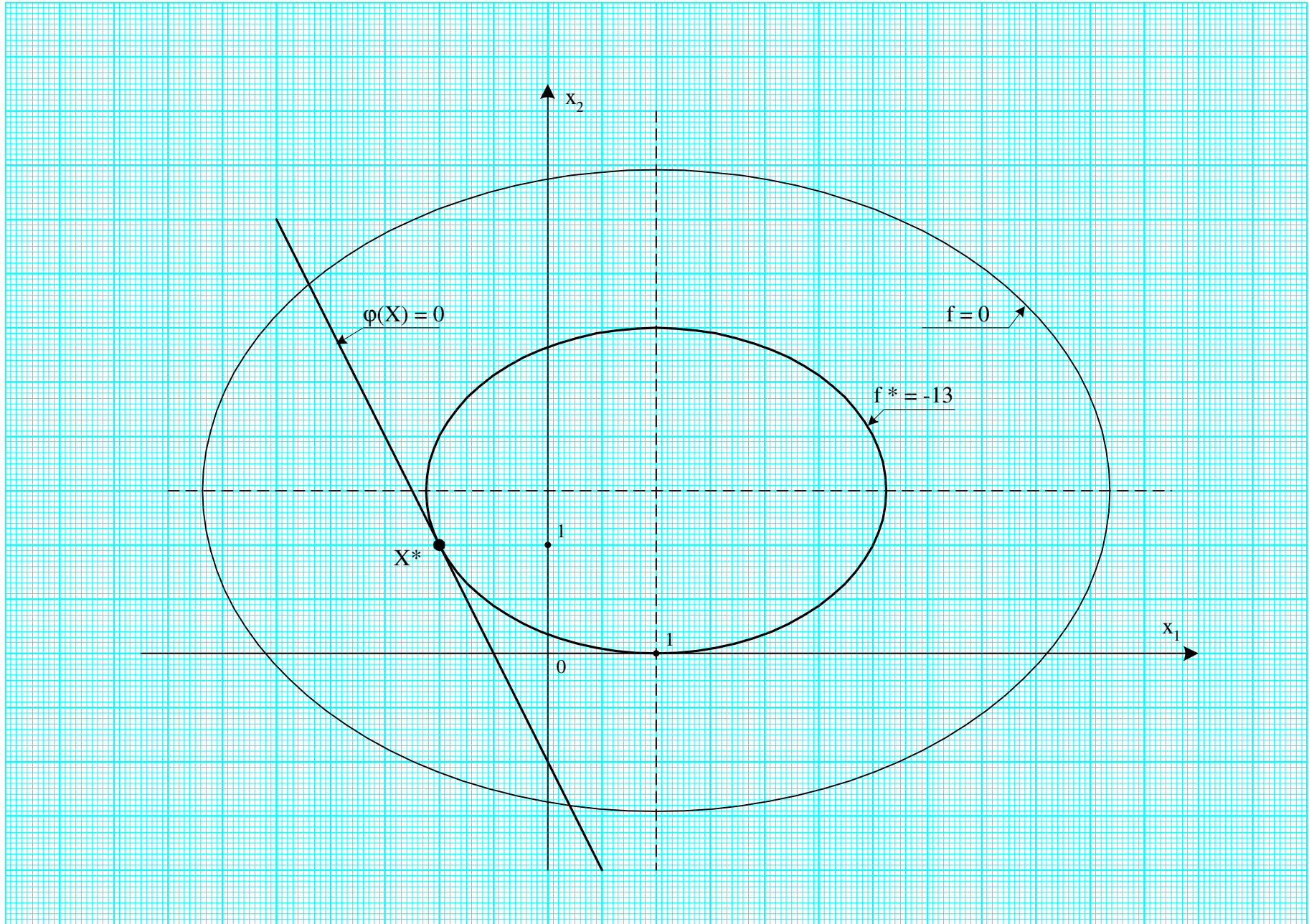
Получены точки с координатами: $(-1.1213, \frac{3}{2})$ и $(3.1213, \frac{3}{2})$

Найдем еще несколько точек для построения эллипса, выразив x_1 из канонического уравнения эллипса:

$$x_1 = \pm \sqrt{\left(1 - \frac{(x_2 - \frac{3}{2})^2}{\frac{9}{4}}\right)} \cdot \frac{9}{2} + 1$$

x_2	x_1	x_1
0	1	1
0.5	2.5811	-0.5811
1	3	-1
1.5	3.1213	-1.1213
2	3	-1
2.5	2.5811	-0.5811
3	1	1

Построим на чертеже линию уровня функции.



Задание 1б).

Дано: $f(X) = x_1^2 + 2x_2^2 - 2x_1 - 6x_2 - 12 \rightarrow \text{extr}$
 $2x_1 + x_2 = -1$

Решить задачу методом множителей Лагранжа (аналитически отыскать экстремум функции при ограничениях типа равенства, используя аппарат необходимых и достаточных условий)

Решение:

Запишем классическую функцию Лагранжа:

$$L(X, \lambda) = x_1^2 + 2x_2^2 - 2x_1 - 6x_2 - 12 + \lambda_1(2x_1 + x_2 + 1).$$

Запишем необходимые условия экстремума функции при ограничениях типа равенства:

$$\begin{cases} \frac{\partial L(X, \lambda)}{\partial x_1} = 2x_1 - 2 + 2\lambda_1 = 0 \\ \frac{\partial L(X, \lambda)}{\partial x_2} = 4x_2 - 6 + \lambda_1 = 0 \\ \varphi_1(X) = 2x_1 + x_2 + 1 = 0 \end{cases}$$

Решим полученную систему:

$$\begin{cases} 2x_1 - 2 + 2\lambda_1 = 0 \\ 4x_2 - 6 + \lambda_1 = 0 \\ 2x_1 + x_2 + 1 = 0 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} 2x_1 + 2\lambda_1 = 2 \\ 4x_2 + \lambda_1 = 6 \\ 2x_1 + x_2 = -1 \end{cases} \xrightarrow{(1)-(3)} \begin{cases} -x_2 + 2\lambda_1 = 3 \\ 4x_2 + \lambda_1 = 6 \\ 2x_1 + x_2 = -1 \end{cases} \xrightarrow{4 \cdot (1) + (2)}$$

$$\begin{cases} 9\lambda_1 = 18 \\ 4x_2 + \lambda_1 = 6 \\ 2x_1 + x_2 = -1 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} \lambda_1 = 2 \\ x_2 = \frac{6 - \lambda_1}{4} \\ x_1 = \frac{-1 - x_2}{2} \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} \lambda_1^* = 2 \\ x_2^* = 1 \\ x_1^* = -1 \end{cases}$$

Таким образом, получено решение системы – точка с координатами $(X^*, \lambda^*) = (-1, 1, 2)^T$ – условно-стационарная точка функции.

Определим характер полученной точки с помощью достаточных условий экстремума.

Запишем второй дифференциал функции Лагранжа:

$$\frac{\partial^2 L(X, \lambda)}{\partial x_1^2} = 2 \qquad \frac{\partial^2 L(X, \lambda)}{\partial x_1 \partial x_2} = \frac{\partial^2 L(X, \lambda)}{\partial x_2 \partial x_1} = 0 \qquad \frac{\partial^2 L(X, \lambda)}{\partial x_2^2} = 4$$

$$d^2L(X, \lambda) = 2(dx_1)^2 + 0 \cdot dx_1 \cdot dx_2 + 0 \cdot dx_1 \cdot dx_2 + 4(dx_2)^2 \quad \Rightarrow \quad \boxed{d^2L(X, \lambda) = 2(dx_1)^2 + 4(dx_2)^2}$$

Запишем дифференциал ограничения Φ_1 :

$$\frac{\partial \Phi_1(X)}{\partial x_1} = 2 \quad \frac{\partial \Phi_1(X)}{\partial x_2} = 1 \quad \Rightarrow \quad \boxed{d\Phi_1(X) = 2 \cdot dx_1 + 1 \cdot dx_2}$$

В точке $X^* = (-1, 1, 2)$ имеем:

$$d^2L(X^*) = 2(dx_1)^2 + 4(dx_2)^2 \text{ при условии } d\Phi_1(X^*) = 2 \cdot dx_1 + 1 \cdot dx_2 = 0,$$

получим:

$$dx_2 = -2dx_1 \quad \Rightarrow \quad d^2L(X^*) = 18(dx_1)^2 > 0 \text{ при } dx_1 \neq 0$$

Следовательно, в точке $X^* = (-1, 1)^T$ выполнены достаточные условия локального условного минимума.

Ответ: функции $f(X)$ при ограничении $2x_1 + x_2 = -1$ имеет условный локальный минимум в точке с координатами $X^* = (-1, 1)$, $f(X^*) = -13$.

Задание 1в).

Дано: $f(X) = x_1^2 + 2x_2^2 - 2x_1 - 6x_2 - 12 \rightarrow \text{extr}$
 $2x_1 + x_2 = -1$

Найти решение задачи методом штрафной функции

Решение:

Составим вспомогательную функцию:

$$F(X, r) = x_1^2 + 2x_2^2 - 2x_1 - 6x_2 - 12 + \frac{r}{2}(2x_1 + x_2 + 1)^2$$

Внимание!

В случае поиска условного максимума, используют вспомогательную

функцию вида: $F(X, r) = f(X) - \frac{r}{2} \sum_{j=1}^m \varphi_j^2(X)$

Запишем необходимые условия безусловного минимума вспомогательной функции:

$$\begin{cases} \frac{\partial F(X, r)}{\partial x_1} = 2x_1 - 2 + r \cdot (2x_1 + x_2 + 1) \cdot 2 = 0 \\ \frac{\partial F(X, r)}{\partial x_2} = 4x_2 - 6 + r \cdot (2x_1 + x_2 + 1) = 0 \end{cases}$$

Преобразуем исходную систему к виду: $\begin{cases} (2 + 4r) \cdot x_1 + 2r \cdot x_2 = 2 - 2r \\ 2r \cdot x_1 + (4 + r) \cdot x_2 = 6 - r \end{cases}$

Разрешим полученную систему относительно переменных x_1, x_2 по правилу Крамера:

$$\Delta = \begin{vmatrix} 2 + 4r & 2r \\ 2r & 4 + r \end{vmatrix} = (2 + 4r) \cdot (4 + r) - 4r^2 = 8 + 16r + 2r + 4r^2 - 4r^2 = 18r + 8$$

$$\Delta_1 = \begin{vmatrix} 2 - 2r & 2r \\ 6 - r & 4 + r \end{vmatrix} = (2 - 2r) \cdot (4 + r) - 2r(6 - r) = 8 - 8r + 2r - 2r^2 - 12r + 2r^2 = -18r + 8$$

$$\Delta_2 = \begin{vmatrix} 2 + 4r & 2 - 2r \\ 2r & 6 - r \end{vmatrix} = (2 + 4r) \cdot (6 - r) - 2r(2 - 2r) = 12 + 24r - 2r - 4r^2 - 4r + 4r^2 = 18r + 12$$

Тогда $x_1^*(r) = \frac{-18r + 8}{18r + 8}$, — стационарная точка вспомогательной функции.
 $x_2^*(r) = \frac{18r + 12}{18r + 8}$

Найдем координаты условного экстремума исходной задачи, как предел решения задачи поиска безусловного экстремума вспомогательной функции:

$$x_1^* = \lim_{r \rightarrow \infty} \frac{-18r + 8}{18r + 8} = -1, \quad x_2^* = \lim_{r \rightarrow \infty} \frac{18r + 12}{18r + 8} = 1$$

Получена точка $X^* = (-1, 1)^T$ – точка условного экстремума исходной задачи.

Запишем матрицу Гессе для вспомогательной функции: $H(X, r) = \begin{pmatrix} 2+4r & 2r \\ 2r & 4+r \end{pmatrix}$

Используем критерий Сильвестра:

$$\Delta_1 = 2 + 4r > 0 \text{ при } r \rightarrow \infty$$

$$\Delta_2 = (2 + 4r)(4 + r) - 4r^2 = 8 + 16r + 2r + 4r^2 - 4r^2 = 8 + 18r > 0 \text{ при } r \rightarrow \infty$$

Следовательно, выполняются достаточные условия минимума функции $F(X, r)$, а значит полученная точка $X^* = (-1, 1)^T$ – точка условного локального минимума функции $f(X)$.

Запишем оценку λ_1^* :

$$\begin{aligned} \lambda_1^* &= \lim_{r \rightarrow \infty} r \cdot \left(2 \cdot \frac{-18r+8}{18r+8} + \frac{18r+12}{18r+8} + 1 \right) = \lim_{r \rightarrow \infty} r \cdot \left(\frac{-36r+16+18r+12+18r+8}{18r+8} \right) = \\ &= \lim_{r \rightarrow \infty} r \cdot \left(\frac{36}{18r+8} \right) = 2 \end{aligned}$$

Внимание !

В случае поиска условного максимума, используют формулу:

$$\lambda_j^* = - \lim_{r \rightarrow \infty} r \cdot \varphi_j(X^*(r))$$

Ответ: функции $f(X)$ при ограничении $2x_1 + x_2 = -1$ имеет условный локальный минимум в точке с координатами $X^* = (-1, 1)$, $f(X^*) = -13$.