

Arens

Optimierungstheorie

Dauer: 120 min. Lösung: offiziell Bestanden mit: XX P.
Bemerkungen: (Hilfsmittel, Nachklausur, etc)

Aufgabe 1 Der Osterhase experimentiert mit seinem Rezept für magische blaue Ostereierfarbe herum, um die Ergiebigkeit zu steigern. Für das Rezept werden die drei Zutaten *Enzianblütenblätter*, *Blaubeersaft* und *Saphirstaub* verwendet. Durch seine Experimente findet der Osterhase heraus, dass die Anzahl der mit der Farbe bemalbaren Eier proportional zum Wert der Funktion

$$f(x) = x_1^2 \sqrt{x_2} \sqrt[3]{x_3}$$

ist, wobei $x_j > 0$, $j = 1, 2, 3$, jeweils die verwendeten Mengeneinheiten an Enzianblütenblättern (Säcke), Blaubeersaft (Fässer) und Saphirstaub (Prisen) bezeichnet.

Der Osterhase hat außerdem die folgenden Zusammenhänge herausgefunden:

$$\frac{x_2}{x_1} \leq 2, \quad x_1 x_2^2 \leq e^4 x_3, \quad x_3 \geq 1.$$

Das Optimierungsproblem des Osterhasen ist es, den Wert von f unter Beachtung dieser Zusammenhänge zu maximieren.

- Zeigen Sie, dass dieses Problem äquivalent zu einem linearen Optimierungsproblem ist.
- Formulieren Sie dieses äquivalente lineare Optimierungsproblem in Normalform.

Hinweis: Betrachten Sie $\log f(x)$.

Aufgabe 2 Lösen Sie das folgende lineare Optimierungsproblem mit Hilfe des Simplex-Verfahrens:

$$\text{Max}_{x \in M} x_1 + x_2 + x_3$$

auf

$$M = \{x \in \mathbb{R}_{\geq 0}^3 : x_1 + x_3 \leq 3, \quad 2x_2 - 3x_3 \geq 3x_1 - 5, \quad 2x_1 - x_3 \leq 2 - x_2\}.$$

Aufgabe 3 Gegeben ist das Optimierungsproblem

$$(P) \quad \text{Min}_{x \in M} f(x) \quad \text{auf} \quad M = \{x = (x_1, x_2)^\top \in \mathbb{R}^2 : x_1 + x_2 \geq 1\}.$$

mit $f(x) = e^{x_1 + x_2^2}$, $x \in \mathbb{R}^2$.

- Zeigen Sie, dass es sich um ein konvexes Optimierungsproblem handelt.
- Stellen Sie das zu (P) duale Problem auf, wobei die Zielfunktion explizit zu bestimmen ist.
- Lösen Sie das duale Problem.
- Bestimmen Sie die Lösung von (P) unter Verwendung des Sattelpunktsatzes.

Aufgabe 4 Gegeben ist die Menge $M = \{(x, y) \in \mathbb{R}^2 : (1+x)(1+x^2) \leq y^2\}$. Gesucht sind Punkte in M mit minimalem Abstand zum Ursprung.

- Formulieren die Problemstellung als differenzierbares Optimierungsproblem und zeigen Sie, dass es eine Lösung hat.
- Bestimmen Sie alle $(x, y) \in M$, für die die Mangasarian-Fromowitz-Bedingung (MFB) erfüllt ist.
- Bestimmen Sie alle KKT-Punkte für das Optimierungsproblem.
- Bestimmen Sie alle Punkte in M mit minimalem Abstand zum Ursprung.

Aufgabe 5

(a) Die Mengen $K_1, K_2 \subseteq \mathbb{R}^n$ seien nichtleer, abgeschlossen und konvex. Ferner sei K_1 kompakt. Zeigen Sie:

(i) $K_1 - K_2 = \{z = x - y : x \in K_1, y \in K_2\}$ ist abgeschlossen.

(ii) Ist $K_1 \cap K_2 = \emptyset$, so gibt es eine Hyperebene, die K_1 und K_2 strikt trennt, d.h. es gibt $a \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$ und $\gamma \in \mathbb{R}$ mit

$$a^\top x < \gamma < a^\top y \quad \text{für alle } x \in K_1, y \in K_2.$$

(b) Die Teilmengen des \mathbb{R}^2

$$K_1 = \{(x_1, x_2) \in \mathbb{R}^2 : x_2 \geq e^{x_1}\}, \quad K_2 = \{(x_1, x_2) \in \mathbb{R}^2 : x_2 \leq 0\}$$

sind beide nichtleer, abgeschlossen und konvex. Zeigen oder widerlegen Sie die Aussage: K_1 und K_2 können durch eine Gerade strikt getrennt werden.

Aufgabe 1

Lösung: (a) Wir führen $y_j = \log(x_j)$ ein und erhalten

$$\log f(x) = \log(x_1^2 \sqrt{x_2} \sqrt[3]{x_3}) = 2y_1 + \frac{1}{2}y_2 + \frac{1}{3}y_3 =: g(y).$$

Durch Anwendung des Logarithmus auf die Nebenbedingungen erhalten wir

$$y_2 - y_1 \leq \log(2), \quad y_1 + 2y_2 - y_3 \leq 4, \quad y_3 \geq 0.$$

Das ursprüngliche Problem lautet

$$(P) \quad \text{Max}_{x \in M} f(x) \quad \text{auf} \quad M = \left\{ x \in \mathbb{R}_{>0}^2 \times \mathbb{R}_{\geq 1} : \frac{x_2}{x_1} \leq 2, x_1 x_2^2 \leq e^4 x_3 \right\},$$

und wir betrachten das lineare Problem

$$(LP) \quad \text{Max}_{y \in N} g(y) \quad \text{auf} \quad N = \{y \in \mathbb{R}^2 \times \mathbb{R}_{\geq 0} : y_2 - y_1 \leq \log(2), y_1 + 2y_2 - y_3 \leq 4\}.$$

Zusätzlich führen wir die Funktion $\Psi(x) = (\log(x_1), \log(x_2), \log(x_3))$, $x \in M$, ein. Da die Logarithmus-Funktion streng monoton wachsend ist, folgt, dass $\Psi(M) = N$ und dass Ψ bijektiv ist.

Sei nun $\hat{x} \in M$ Lösung von (P), und wir nehmen an, dass $\hat{y} \in N$ die Bedingung $g(\hat{y}) > g(\Psi(\hat{x}))$ erfüllt. Dies ist äquivalent zu $f(\Psi^{-1}(\hat{y})) > f(\hat{x})$, was der Annahme widerspricht, dass \hat{x} Lösung von (P) ist. Somit ist $\Psi(\hat{x})$ Lösung von (LP). Umgekehrt folgt ganz analog, dass für eine Lösung $\hat{y} \in N$ von (LP) auch $\Psi^{-1}(\hat{y})$ Lösung von (P) ist. Damit sind die beiden Optimierungsprobleme äquivalent.

(b) Um (LP) in Normalform anzugeben, schreiben wir $y_1 = z_1 - z_2$, $y_2 = z_3 - z_4$ mit $z_j \geq 0$, $j = 1, \dots, 4$, und setzen $z_5 = y_3$. Ferner führen wir zwei Schlupfvariablen $z_6, z_7 \geq 0$ für die beiden Nebenbedingungen in N ein. Damit erhalten wir in Normalform

$$(NP) \quad \text{Min}_{z \in \tilde{N}} -2z_1 + 2z_2 - \frac{1}{2}z_3 + \frac{1}{2}z_4 - \frac{1}{3}z_5$$

$$\tilde{N} = \{z \in \mathbb{R}_{\geq 0}^7 : -z_1 + z_2 + z_3 - z_4 + z_6 = \log(2), \quad z_1 - z_2 + 2z_3 - 2z_4 - z_5 + z_7 = 4\}.$$

Aufgabe 2

Lösung: Zunächst formulieren wir das Problem in Normalform. Da $M \subseteq \mathbb{R}_{\geq 0}^3$ bereits erfüllt ist, müssen nur zusätzliche Schlupfvariablen $x_4, x_5, x_6 \geq 0$ eingeführt werden. Das Problem lautet dann:

$$\text{Min}_{y \in \widehat{M}} -x_1 - x_2 - x_3 \quad \text{auf} \quad \widehat{M} = \left\{ x \in \mathbb{R}_{\geq 0}^6 : \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 0 \\ 3 & -2 & 3 & 0 & 1 & 0 \\ 2 & 1 & -1 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ \vdots \\ x_6 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 3 \\ 5 \\ 2 \end{pmatrix} \right\}$$

Es kann direkt die zulässige Basislösung $(0, 0, 0, 3, 5, 2)^\top$ abgelesen werden, so dass wir direkt die Phase II des Simplex-Verfahrens starten können.

$$(T0) \quad \begin{array}{cccccc|c} -1 & -1 & -1 & 0 & 0 & 0 & \eta \\ \hline 1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 0 & 3 \\ 3 & -2 & 3 & 0 & 1 & 0 & 5 \\ \boxed{2} & 1 & -1 & 0 & 0 & 1 & 2 \\ & & & \uparrow & \uparrow & \uparrow & \end{array}$$

$$(T1) \quad \begin{array}{cccccc|c} 0 & -\frac{1}{2} & -\frac{3}{2} & 0 & 0 & \frac{1}{2} & \eta + 1 \\ \hline 0 & -\frac{1}{2} & \frac{3}{2} & 1 & 0 & -\frac{1}{2} & 2 \\ 0 & -\frac{1}{2} & \frac{5}{2} & 0 & 1 & -\frac{3}{2} & 2 \\ 1 & \boxed{\frac{1}{2}} & -\frac{1}{2} & 0 & 0 & \frac{1}{2} & 1 \\ \uparrow & & & \uparrow & \uparrow & & \end{array}$$

$$(T2) \quad \begin{array}{cccccc|c} 1 & 0 & -2 & 0 & 0 & 1 & \eta + 2 \\ 1 & 0 & \boxed{1} & 1 & 0 & 0 & 3 \\ 7 & 0 & 1 & 0 & 1 & 2 & 9 \\ 2 & 1 & -1 & 0 & 0 & 1 & 2 \\ & \uparrow & & \uparrow & \uparrow & & \end{array}$$

$$(T3) \quad \begin{array}{cccccc|c} 3 & 0 & 0 & 2 & 0 & 1 & \eta + 8 \\ 1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 0 & 3 \\ 6 & 0 & 0 & -1 & 1 & 2 & 6 \\ 3 & 1 & 0 & 1 & 0 & 1 & 5 \\ & \uparrow & \uparrow & & \uparrow & & \end{array}$$

Damit ist die Phase II beendet, wir haben die zulässige Basislösung $\hat{x} = (0, 5, 3, 0, 6, 0)^\top$ des Problems in Normalform gefunden. Das ursprüngliche Optimierungsproblem hat somit die Lösung $x^* = (0, 5, 3)$ mit maximalen Zielfunktionswert 8.

Aufgabe 3

Lösung: (a) Es ist $f'(x) = (1, 2x_2) e^{x_1+x_2^2}$. Die Hesse-Matrix lautet

$$\nabla^2 f(x) = \begin{pmatrix} 1 & 2x_2 \\ 2x_2 & 2 + 4x_2^2 \end{pmatrix} e^{x_1+x_2^2}.$$

Da die e-Funktion stets positiv ist, reicht es aus zu zeigen, dass beide Eigenwerte der Matrix positiv sind. Das charakteristische Polynom lautet

$$p(\lambda) = (1 - \lambda)(2 + 4x_2^2 - \lambda) - 4x_2^2 = \lambda^2 - (3 + 4x_2^2)\lambda + 2 = \left(\lambda - \frac{3 + 4x_2^2}{2}\right)^2 - \left(\frac{3 + 4x_2^2}{2}\right)^2 + 2.$$

Da

$$\left(\frac{3 + 4x_2^2}{2}\right)^2 \geq \frac{9}{4} \geq 2,$$

gibt es zwei reelle Nullstellen des charakteristischen Polynoms. Diese lauten

$$\lambda_{1/2} = \frac{3 + 4x_2^2}{2} \pm \sqrt{\left(\frac{3 + 4x_2^2}{2}\right)^2 - 2},$$

und sind offensichtlich beide positiv. Somit ist die Zielfunktion konvex.

Die Restriktionsfunktion $h(x) = 1 - x_1 - x_2$ ist linear und damit auch konvex. Insgesamt handelt es sich also um ein konvexes Optimierungsproblem.

(b) Die Lagrange-Funktion zu (P) ist

$$L(x, u) = e^{x_1+x_2^2} + u(1 - x_1 - x_2).$$

Wir schreiben dies um zu $L(x, u) = L_1(x_1 + x_2^2, u) + L_2(x_2, u)$ mit

$$L_1(y, u) = e^y + u(1 - y), \quad L_2(x_2, u) = u(x_2^2 - x_2).$$

Elementare Überlegungen aus der Analysis einer Funktion einer Variable zeigen, dass für jedes $u \geq 0$ die Funktionen $y \mapsto L_1(y, u)$ und $x_2 \mapsto L_2(x_2, u)$ nach unten beschränkt sind. Also ist die Zielfunktion F des dualen Problems für alle $u \geq 0$ definiert.

Wir bestimmen einen expliziten Ausdruck, indem wir die Minimalstellen der obigen Funktionen bestimmen. Für $u = 0$ ist das Infimum beider Funktionen null, also auch $F(0) = 0$. Für $u > 0$ ist

$$\begin{aligned} \frac{\partial L_1(y, u)}{\partial y} &= e^y - u \stackrel{!}{=} 0, & \text{also } y &= \log(u), \\ \frac{\partial L_2(x_2, u)}{\partial x_2} &= u(2x_2 - 1) \stackrel{!}{=} 0, & \text{also } x_2 &= \frac{1}{2}. \end{aligned}$$

Resubstituieren wir $y = x_1 + x_2^2$, so ergibt sich $(x_1, x_2) = (\log(u) - \frac{1}{4}, \frac{1}{2})$. In diesem Fall ist

$$F(u) = u + u \left(1 - \log(u) + \frac{1}{4} - \frac{1}{2} \right) = \frac{7}{4}u - u \log(u).$$

(c) Wir suchen nach einer Stelle $u > 0$ mit $F'(u) = 0$. Es ist

$$F'(u) = \frac{3}{4} - \log(u).$$

Somit ist $\hat{u} = e^{3/4}$ die einzige Stelle mit $F'(\hat{u}) = 0$. An dieser Stelle ist $F(\hat{u}) = \frac{7}{4}e^{3/4} - \frac{3}{4}e^{3/4} = e^{3/4} > 0$. Da $F(0) = 0$ und $\lim_{u \rightarrow \infty} F(u) = -\infty$, handelt es sich um das globale Maximum von F .

(d) Wir haben die Lösung \hat{u} des dualen Problems gefunden. Sei \hat{x} Lösung des konvexen Problems. Dann gilt nach dem Sattelpunktsatz:

$$L(\hat{x}, u) \leq L(\hat{x}, \hat{u}) \leq L(x, \hat{u}) \quad \text{für alle } x \in \mathbb{R}^2, u \geq 0.$$

Somit ist \hat{x} globale Minimalstelle der Funktion $x \mapsto L(x, \hat{u})$. Diese Minimalstelle haben wir in (b) schon in Abhängigkeit von u bestimmt. Existiert also überhaupt eine Lösung \hat{x} des konvexen Problems, so gilt

$$\hat{x}_1 = \log(\hat{u}) - \frac{1}{4} = \frac{3}{4} - \frac{1}{4} = \frac{1}{2}, \quad \hat{x}_2 = \frac{1}{2}.$$

Umgekehrt ist $(\frac{1}{2}, \frac{1}{2}) \in M$, und es gilt

$$L\left(\frac{1}{2}, \frac{1}{2}, u\right) = e^{3/4} \quad \text{für alle } u \geq 0.$$

Somit erfüllt $(\hat{x}, \hat{u}) \in M \times \mathbb{R}_{\geq 0}$ die Ungleichungskette aus dem Sattelpunktsatz, so dass \hat{x} Lösung des konvexen Optimierungsproblems ist.

Aufgabe 4

Lösung: (a) Das Optimierungsproblem lautet

$$(P) \quad \min_{x \in M} f(x) = x^2 + y^2 \quad \text{auf } M = \{(x, y) \in \mathbb{R}^2 : h(x, y) \leq 0\}$$

mit $h(x, y) = (1 + x)(1 + x^2) - y^2$.

Die Menge M ist abgeschlossen (da h stetig ist), aber nicht beschränkt. Betrachte daher $\tilde{M} = \{(x, y) \in M : |(x, y)| \leq 1\}$. Die Menge \tilde{M} ist beschränkt, abgeschlossen und nichtleer, denn $(-1, 0) \in \tilde{M}$. Da f stetig ist, nimmt f auf \tilde{M} sein Minimum an. Die Minimalstellen von f auf \tilde{M} sind gleichzeitig Minimalstellen von f auf M , denn $f > 1$ auf $M \setminus \tilde{M}$ und $f \leq 1$ auf \tilde{M} . Damit sind sie auch Lösungen von (P).

(b) Gesucht sind alle $(x, y) \in M$, so dass ein $(z_1, z_2) \in \mathbb{R}^2$ existiert mit

$$(1 + x)(1 + x^2) - y^2 + z_1(1 + 2x + 3x^2) - 2z_2y < 0.$$

Betrachte zunächst den Fall $y \neq 0$. Wähle $z_1 = 0$ und z_2 so, dass $(1 + x)(1 + x^2) - y^2 < 2z_2y$ ist.

Nun betrachte den Fall $y = 0$. Beachte das $1 + 2x + 3x^2 = (1 + x)^2 + 2x^2 > 0$ für alle $x \in \mathbb{R}$ gilt. Somit ist die (MFB) erfüllt, falls

$$z_1 < -\frac{1 + x + x^2 + x^3}{1 + 2x + 3x^2}.$$

Insgesamt ist die (MFB) also für alle $(x, y) \in M$ erfüllt.

(c) Die Lagrange-Funktion für das Optimierungsproblem lautet

$$L(x, y, u) = x^2 + y^2 + u((1 + x)(1 + x^2) - y^2).$$

Somit lauten die KKT-Bedingungen: $2x + u(1 + 2x + 3x^2) = 0,$

$$2y - 2uy = 0,$$

$$u(1 + x + x^2 + x^3 - y^2) = 0.$$

Zunächst sei $u = 0$. Die ersten beiden Gleichungen implizieren dann $(x, y) = (0, 0)$.

Ist $u \neq 0$, so folgt aus der zweiten Gleichung $y = 0$ oder $u = 1$. Mit $y = 0$ erhalten wir sofort $x = -1$ aus der dritten und $u = 1$ aus der ersten Gleichung.

Schließlich betrachten wir noch $u = 1$. Dann ist die erste Gleichung äquivalent zu $1 + 4x + 3x^2 = 0$. Die Lösungen sind $x = -1$ und $x = -1/3$. Im ersten Fall erhalten wir aus der letzten Gleichung wieder $y = 0$, im zweiten Fall ist $y^2 = 20/27$, also $y = \pm(2/3) \cdot \sqrt{5/3}$.

Insgesamt haben wir die KKT-Punkte

$$(0, 0, 0), \quad (-1, 0, 1), \quad \left(-\frac{1}{3}, -\frac{2}{3}\sqrt{\frac{5}{3}}, 1\right), \quad \left(-\frac{1}{3}, +\frac{2}{3}\sqrt{\frac{5}{3}}, 1\right)$$

gefunden.

(d) Wir betrachten die ersten beiden Koordinaten der KKT-Punkte. Der Punkt $(0, 0)$ liegt nicht in M . Der Punkt $(-1, 0)$ liegt in M und hat den Abstand 1 vom Ursprung. Die beiden letzten Punkte liegen ebenfalls in M und ihr Abstand vom Ursprung ist $\sqrt{23/27} < 1$. Also sind dies die gesuchten Punkte aus M mit minimalem Abstand zum Ursprung.

Aufgabe 5

Lösung: (a), (i): Betrachte eine Folge (z_n) aus $K_1 - K_2$ mit $z_n \rightarrow z$ für $n \rightarrow \infty$. Zu zeigen ist $z \in K_1 - K_2$.

Schreibe $z_n = x_n - y_n$ mit $x_n \in K_1, y_n \in K_2$. Da K_1 kompakt ist, gibt es eine Teilfolge (x_{n_k}) mit $x_{n_k} \rightarrow x \in K_1$ für $k \rightarrow \infty$. Da (z_{n_k}) und (x_{n_k}) konvergieren, existiert auch $y = \lim_{k \rightarrow \infty} y_{n_k}$. Da K_2 abgeschlossen ist, ist $y \in K_2$. Somit gilt

$$z = \lim_{k \rightarrow \infty} (x_{n_k} - y_{n_k}) = x - y \in K_1 - K_2.$$

(a), (ii): Wir zeigen zunächst, dass $K_1 - K_2$ konvex ist. Sei $z_1 = x_1 - y_1, z_2 = x_2 - y_2$ mit $x_1, x_2 \in K_1, y_1, y_2 \in K_2$. Dann gilt für alle $\alpha \in [0, 1]$:

$$\alpha z_1 + (1 - \alpha) z_2 = \alpha (x_1 - y_1) + (1 - \alpha) (x_2 - y_2) = [\alpha x_1 + (1 - \alpha) x_2] - [\alpha y_1 + (1 - \alpha) y_2] \in K_1 - K_2,$$

da beide Mengen konvex sind. Somit ist auch $K_1 - K_2$ konvex.

Da $K_1 \cap K_2 = \emptyset$, ist $0 \in \mathbb{R}^n \setminus (K_1 - K_2)$. Die Menge $K_1 - K_2$ ist abgeschlossen, konvex und nichtleer. Nach dem Trennungssatz gibt es somit ein $a \in \mathbb{R}^n \setminus \{0\}$ und $\beta \in \mathbb{R}$ mit

$$a^\top z \leq \beta < a^\top 0 = 0 \quad \text{für alle } z \in K_1 - K_2.$$

Wir schreiben wieder $z = x - y$ mit $x \in K_1, y \in K_2$ und erhalten, da $\beta < 0$ ist,

$$a^\top x \leq \beta + a^\top y < \frac{\beta}{2} + a^\top y < a^\top y \quad \text{für alle } x \in K_1, y \in K_2.$$

Da K_1 kompakt ist, existiert $\max_{x \in K_1} a^\top x$, und es ist $\max_{x \in K_1} a^\top x \leq \inf_{y \in K_2} a^\top y$. Mit $\gamma = \frac{\beta}{2} + \inf_{y \in K_2} a^\top y$ folgt schließlich

$$a^\top x \leq \frac{\beta}{2} + \gamma < \gamma < a^\top y \quad \text{für alle } x \in K_1, y \in K_2.$$

(b) Die einzigen Geraden im \mathbb{R}^2 , die das Innere von K_2 nicht schneiden, sind Geraden der Form $\{x_2 = c\}$ für $c \geq 0$. Von diesen hat nur die Gerade $\{x_2 = 0\}$ einen leeren Schnitt mit dem Inneren von K_1 . Somit ist dies auch die einzige Gerade im \mathbb{R}^2 , die die beiden Mengen trennt. Da die Gerade aber in K_2 enthalten ist, trennt sie die beiden Mengen nicht strikt. Es gibt also keine Gerade im \mathbb{R}^2 , die das tut.

Dies ist kein Widerspruch zu der Aussage in (a) (ii), denn keine der beiden Mengen K_1, K_2 ist kompakt.