

# Итерационное отображение фейеровского типа для решения системы линейных алгебраических уравнений с двухсторонними ограничениями

В.И. Ерохин

<sup>1</sup>Военно-космическая академия имени А.Ф. Можайского, Санкт-Петербург, Россия  
[vka@mil.ru](mailto:vka@mil.ru)



Семинар по оптимизации, машинному обучению  
и искусственному интеллекту «O&ML»

19 декабря 2024 г.

Детально о фейеровском решателе системы  $Ax = b, x \geq 0$ :  
[http://oml.cmlaboratory.com/pdf/2023/Erohin\\_VI\\_2nov2023.pdf](http://oml.cmlaboratory.com/pdf/2023/Erohin_VI_2nov2023.pdf)

## Новое итерационное отображение фейеровского типа для решения системы линейных алгебраических уравнений с условием неотрицательности

В.И. Ерохин

<sup>1</sup>Военно-космическая академия имени А.Ф. Можайского, Санкт-Петербург, Россия  
[vka@mil.ru](mailto:vka@mil.ru)



Семинар по оптимизации, машинному обучению  
и искусственному интеллекту «O&ML»

2 ноября 2023 г.

О фейеровском решателе задачи ЛП  $L : Ax = b, x \geq 0, c^T x \rightarrow \max,$   
 $L^* : A^T u \geq c, b^T u \rightarrow \min$

A method for solving a dual pair of linear programming problems based on the fast Fejér type algorithm for finding a nonnegative solution to a system of linear algebraic equations

В.И. Ерохин, д.ф.м.н., проф.

<sup>1</sup>Военно-космическая академия имени А.Ф. Можайского, Санкт-Петербург, Россия  
vka@mil.ru



XXIII Международная конференция  
«Теория математической оптимизации и исследование операций»

**MOTOR-2024**

30 июня – 6 июля, 2024

## Главная задача и связанные подзадачи

## Главная задача

$$L : Ax = b, x \geq 0, c^T x \rightarrow \max, L^* : A^T u \geq c, b^T u \rightarrow \min$$

## Основная задача - создать решатель 1 (P1) для системы

$$Ax = b, x \geq 0$$

## Подзадача 1 - на основе P1 создать P2 для системы

$$Cx \leq d \rightarrow (Ax + y = d, y \geq 0)$$

## Подзадача 2 - на основе P1 и P2 создать P для системы

$$Ax = b, x \geq 0, A^T u \geq c, c^T x = b^T u \rightarrow \\ \rightarrow (Ax = b, A^T u + y = c, y \leq 0, c^T x = b^T u)$$

## Формулы для псевдообратных матриц подзадач 1,2

$$\begin{bmatrix} C_{m \times n} : I_m \end{bmatrix}^+ = \begin{bmatrix} D_n C_{n \times m}^+ \\ I_m - C_{m \times n} D_n C_{n \times m}^+ \end{bmatrix}, D_n = \left( I_n + C_{n \times m}^+ C_{m \times n} \right)^{-1},$$

$$\begin{bmatrix} A_{m \times n} : 0_{m \times m} : 0_{m \times n} \\ 0_n : A_{n \times m}^\top : I_n \end{bmatrix}^+ = \begin{bmatrix} A_{n \times m}^+ : 0_n \\ 0_{m \times m} : \tilde{D}_m A_{m \times n}^{+\top} \\ 0_{n \times m} : I_n - A_{n \times m}^\top \tilde{D}_m A_{m \times n}^{+\top} \end{bmatrix}, \tilde{D}_m = \left( I_m + A_{m \times n}^{+\top} A_{n \times m}^+ \right)^{-1},$$

$$\begin{bmatrix} A_{m \times n} : 0_{m \times m} : 0_{m \times n} \\ 0_n : A_{n \times m}^\top : I_n \\ c_{1 \times n}^\top : -b_{1 \times m}^\top : 0_{1 \times n} \end{bmatrix}^+ = \begin{bmatrix} A_{n \times m}^+ : 0_n \\ 0_{m \times m} : \tilde{D}_m A_{m \times n}^{+\top} \\ 0_{n \times m} : I_n - A_{n \times m}^\top \tilde{D}_m A_{m \times n}^{+\top} \end{bmatrix} - qd^\top : q, \begin{matrix} \vdots \\ \vdots \\ \vdots \end{matrix}$$

$$d = \begin{bmatrix} A_{m \times n}^{+\top} c_{n \times 1} \\ A_{n \times m}^+ \tilde{D}_m b_{m \times 1} \end{bmatrix}, p = \begin{bmatrix} (I_n - A_{n \times m}^+ A_{m \times n}) c_{n \times 1} \\ (I_m - A_{m \times n} A_{n \times m}^+ \tilde{D}_m) b_{m \times 1} \\ A_{n \times m}^+ \tilde{D}_m b_{m \times 1} \end{bmatrix}, q = \frac{p}{p^\top p}.$$

## Литература – математический аппарат матричных выкладок



*Гантмахер Ф.Р.* Теория матриц. – 5-е изд., – М.: ФИЗМАТЛИТ, 2010. – 560 с. (Псевдообратная матрица, алгоритм Гревилля)



*Алберт А.* Регрессия, псевдоинверсия и рекуррентное оценивание. – М.: Наука, 1977. – 224 с. (Псевдообращение блочных матриц)



*Голуб Дж., Ван Лоун Ч.* Матричные вычисления. – М.: Мир, 1999. – 548 с. (Формула Шермана-Моррисона-Вудбери)

 Псевдообратная матрица. Детально:

[http://oml.cmlaboratory.com/pdf/2023/Erohin\\_VI\\_9mar2023.pdf](http://oml.cmlaboratory.com/pdf/2023/Erohin_VI_9mar2023.pdf)

Пусть  $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$  – некоторая матрица,  $\text{rank } A = r \leq \min\{m, n\}$ .  
Псевдообратной к матрице  $A$  будем называть матрицу  $A^+ \in \mathbb{R}^{n \times m}$ ,  
для которой выполняются

**уравнения Пенроуза:**

$$AA^+A = A, \quad (1)$$

$$A^+AA^+ = A^+, \quad (2)$$

$$(AA^+)^T = AA^+, \quad (3)$$

$$(A^+A)^T = A^+A. \quad (4)$$

**Утверждение 1.** Для любой матрицы  $A$  псевдообратная матрица  $A^+$  существует и является единственной.



## $M$ -фейеровские отображения: Определение

Пусть  $\phi : D \rightarrow E$  – некоторое отображение (*итерационная функция*),  $D \subseteq \mathbb{R}^n$ ,  $E \subseteq D$ ,  $M = \{x \in D \mid \phi(x) = x\} \subseteq E$  – множество *неподвижных точек* отображения  $\phi$ ,  $\{x^k\}$  строится по правилу

$$x^{k+1} = \phi(x^k), \quad x^0 \in D, \quad x^0 \notin M, \quad k = 0, 1, \dots$$

### ОПРЕДЕЛЕНИЕ

Отображение  $\phi$  называется  $M$ -фейеровским, если

$$M \neq \emptyset, \quad \|\phi(x) - y\| < \|x - y\| \quad \forall y \in M, \forall (x \in D, x \notin M).$$

(в последующем тексте, в зависимости от контекста,  $\|\cdot\|$  – евклидова векторная норма или спектральная матричная норма).

Класс  $M$ -фейеровских отображений обозначим через  $F_M$ .

## M-фейеровские отображения: Базовые конструкции

### 1. Отображение $\pi_L$

на основе проекции точки на полупространство:

$$L = \{x \mid l(x) = a^T x - \beta \leq 0\}, \quad a, x \in \mathbb{R}^n, \quad \beta \in \mathbb{R}^1, \quad a \neq 0,$$

$$\pi_L(x) = x - \lambda [l(x)]_+ a / a^T a, \quad \lambda \in (0, 2). \quad ([\cdot]_+ - \text{операция положительной срезки (поэлементная)})$$

### 2. Отображение $\pi_+$

на основе проекции точки на  $\mathbb{R}_+^n$ :  $\pi_+(x) = [x]_+$

### 3. Отображение $\pi_X$

на основе проекции точки на множество решений совместной

СЛАУ:  $X = \{x \mid Ax = b\}$ ,  $\pi_X(x) = x + A^+ r(x)$ ,  $r(x) = b - Ax$ . ( $A^+$  – псевдообратная матрица)

**Замечание.** Несложно убедиться, что

$$\pi_+(x) \in \mathbb{R}_+^n, \quad \pi_+(\pi_+(x)) = \pi_+(x), \quad \pi_X(x) \in X, \quad \pi_X(\pi_X(x)) = \pi_X(x).$$

## *M*-фейеровские отображения: Основные свойства

### СВОЙСТВО 1.

Пусть  $\{x^k\}$  построена с помощью  $\phi \in F_M$ . Тогда если  $\{x^k\} \cap M = \emptyset$ , то  $x^k \rightarrow \bar{x} \in M$ , иначе  $\exists k \in \mathbb{N} \mid x^k, x^{k+1}, \dots \in M$ .

### СВОЙСТВО 2.

Пусть  $\phi_\lambda(x) = \lambda\phi(x) + (1 - \lambda)x$ ,  $\lambda \in (0, 1)$ ,  $\phi \in F_M$ . Тогда  $\phi_\lambda \in F_M$ .

### СВОЙСТВО 3.

Пусть  $\phi_j \in F_M$ ,  $\phi(x) = \sum_{j=1}^m \alpha_j \phi_j(x)$ ,  $\alpha_j \geq 0$ ,  $\sum_{j=1}^m \alpha_j = 1$ . Тогда  $\phi \in F_M$ .

### СВОЙСТВО 4.

Пусть  $\phi_j \in F_{M_j}$ ,  $\phi(x) = \phi_1(\phi_2(\dots(\phi_m(x))\dots))$ ,  $M = \bigcap_{j=1}^m M_j \neq \emptyset$ . Тогда  $\phi \in F_M$ .



## $M$ -фейеровское отображение для системы $Ax = b, x \geq 0$

Заметим, что из отображений  $\pi_+$  и  $\pi_X$  может быть построено отображение

$$\tilde{\pi}_{X_+}(x) = \pi_+(\pi_X(x)) = [x + A^+r(x)]_+,$$

которое, в силу свойства 4, является  $X_+$ -фейеровским.



## $X_+$ -фейеровское отображение $\pi_{X_+, \lambda}(x)$ (O&ML, 02.11.2023)

Пусть

$$\pi_{X, \lambda}(x) = x + \lambda A^+ r(x), \lambda \in (0, 2); \pi_{X_+, \lambda}(x) = |\pi_{X, \lambda}(x)|$$

( $|\cdot|$  – поэлементная операция взятия абсолютной величины)

Очевидно, что отображения  $\pi_{X, \lambda}$  и  $\pi_{X_+, \lambda}$  непрерывны,  $\pi_{X, \lambda} : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ . Отображение  $\pi_{X_+, \lambda}$  в последующих выкладках будем рассматривать как отображение из  $\mathbb{R}_+^n$  в  $\mathbb{R}_+^n$ , т.е., как инструмент порождения итерационных числовых последовательностей  $\{x^k\}$  вида

$$x^{k+1} = \pi_{X_+, \lambda}(x^k) \in \mathbb{R}_+^n, x^0 \in \mathbb{R}_+^n, x^0 \notin X_+, k = 0, 1, \dots$$

*Заметим, что отображение  $\pi_{X_+, \lambda}$  в литературе ранее не упоминалось и его свойства ранее не исследовались.*

## Свойства $\pi_{X_+, \lambda}(x)$ (и базы сравнения $\tilde{\pi}_{X_+, \lambda}(x) = [x + \lambda A^+ r(x)]_+$ )

**ЛЕММА 1.**  $\pi_{X, \lambda}(x) \in F_X$       **ТЕОРЕМА 1.**  $\pi_{X_+, \lambda}(x) \in F_{X_+}$

**ТЕОРЕМА 2.** Если  $X_+ \neq \emptyset$  и последовательность  $\{x^k = \pi_{X_+, \lambda}(x^{k-1})\}$  является бесконечной, то  $\lim_{k \rightarrow \infty} x^k = y \in X_+$ ,  $\|\pi_{X_+, \lambda}(x^k) - y\| \leq \theta \cdot \|x^k - y\|$   
 $\forall y \in X_+, \forall x^k \in \mathbb{R}_+^n$ , где  $0 \leq \theta < 1$

**ТЕОРЕМА 3. (Об оценке сходимости  $\{x^k\}$  по сходимости  $\{r(x^k)\}$ )**

Пусть  $X_+ \neq \emptyset$  и последовательность  $\{x^k\}$  является бесконечной. Тогда 1)  $\|r(x^k)\| \rightarrow 0$ , 2) имеет место неравенство

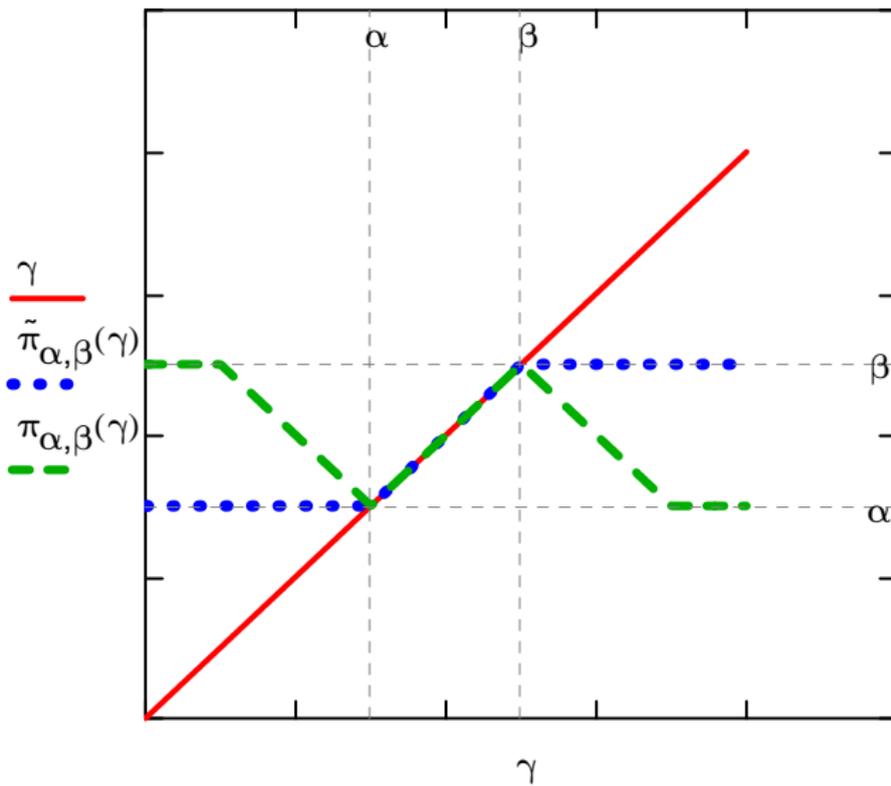
$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{\|r(x^{k+1})\|}{\|r(x^k)\|} \leq \bar{\theta} \|A\| C = \bar{\bar{\theta}},$$

где  $\bar{\bar{\theta}}$  – верхняя оценка константы асимптотики сходимости последовательности  $\{r(x^k)\}$ .

**ТЕОРЕМА 4. (О сходимости  $\{x^k\}$  за конечное число шагов)**

Пусть  $X_+ \neq \emptyset$  и последовательность  $\{x^k\}$  порождается некоторым отображением  $\pi_{X_+, \lambda}$ , где  $\lambda \in [1, 2)$ . Если при этом  $\pi_{X, \lambda}(x^k) \geq 0$  для некоторого  $k \geq 0$ , то  $\pi_{X, \lambda}(x^k) \in X_+$ .





## Важный 'технический' результат

**ЛЕММА 1/2. Фрагмент доказательства  $\pi_{X, \lambda}(x) \in F_X$** 

Пусть  $X \neq \emptyset$  и  $x, y \in \mathbb{R}^n$  – такие, что  $x \notin X, y \in X$ . Тогда ...

$$\|\pi_{X, \lambda}(x) - y\|^2 = \|x - y\|^2 - \lambda(2 - \lambda)\kappa^2,$$

где

$$0 < \kappa = \|A^+ A(x - y)\| \leq \|x - y\|.$$

**Следствие 1.**

$\forall (x \notin X, y \in X) \Rightarrow \|\pi_{X, \lambda}(x) - y\| < \|x - y\| \Leftrightarrow \pi_{X, \lambda}(x) \in F_X.$

**Следствие 2.**  $\forall (x \notin X, y \in X) \Rightarrow \|\pi_{X, \lambda}(x) - y\| \leq \theta \|x - y\|,$

где  $0 \leq \theta \leq \bar{\theta} = \left( \frac{(1-\lambda)^2 + (C\|A\|)^2 - 1}{(C\|A\|)^2} \right)^{\frac{1}{2}}$ ,  $C$  – константа Хоффмана в неравенстве  $\|x - y\| \leq C \|r(x)\|.$

**Следствие 3.**

$\forall (x \notin X, y \in X) \Rightarrow \|r(\pi_{X, \lambda}(x))\| \leq C \|A\| \theta \|r(x)\|.$

Обоснование отображения  $\pi_{X_{\square}, \lambda}(x)$ **Лемма 1.**

$$\forall y \in X_{\square}, \forall x \mid \underline{x} \leq x \leq \bar{x}, r(x) \neq 0 \Rightarrow \|\pi_{X_{\square}, \lambda}(x) - y\| \leq \|\pi_{X, \lambda}(x) - y\|.$$

**Доказательство.** Пусть  $\underline{x} \leq y = \underline{x} + v = \bar{x} - w \leq \bar{x}$ , где  $v, w \in \mathbb{R}^n, v, w \geq 0$ .

Рассмотрим поэлементное представление отображения  $\pi_{X_{\square}, \lambda}(x) = \left( \left( \pi_{X_{\square}, \lambda}(x) \right)_i \right)$ .

Можно показать, что

$$\left( \pi_{X_{\square}, \lambda}(x) \right)_i = \begin{cases} \underline{x}_i + \min \left\{ \left| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right)_i - \underline{x}_i \right|, \bar{x}_i - \underline{x}_i \right\} & \text{при } x_i \leq \frac{\underline{x}_i + \bar{x}_i}{2} \\ \bar{x}_i - \min \left\{ \left| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right)_i - \bar{x}_i \right|, \bar{x}_i - \underline{x}_i \right\} & \text{при } x_i > \frac{\underline{x}_i + \bar{x}_i}{2} \end{cases}$$

$$\text{Следовательно, } \left| \left( \pi_{X_{\square}, \lambda}(x) \right)_i - y_i \right| =$$

$$= \begin{cases} \left| \min \left\{ \left| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right)_i - \underline{x}_i \right|, \bar{x}_i - \underline{x}_i \right\} - v_i \right| (= \sigma) & \text{при } x_i \leq \frac{\underline{x}_i + \bar{x}_i}{2} \\ \left| w_i - \min \left\{ \left| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right)_i - \bar{x}_i \right|, \bar{x}_i - \underline{x}_i \right\} \right| (= \rho) & \text{при } x_i > \frac{\underline{x}_i + \bar{x}_i}{2} \end{cases}$$

Рассмотрим отдельно выражения  $\sigma$  и  $\rho$ :

$$\sigma = \left| \min \left\{ \left| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right)_i - y_i + v_i \right| - v_i, \bar{x}_i - y_i \right\} \right| \leq \left| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right)_i - y_i \right|,$$

$$\rho = \left| \min \left\{ \left| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right)_i - y_i - w_i \right| - w_i, y_i - \underline{x}_i \right\} \right| \leq \left| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right)_i - y_i \right|. \text{ Таким образом,}$$

$$\left| \left( \pi_{X_{\square}, \lambda}(x) \right)_i - y_i \right| \leq \left| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right)_i - y_i \right| \stackrel{\text{абс. норма}}{\Rightarrow} \left\| \left( \pi_{X_{\square}, \lambda}(x) \right) - y \right\| \leq \left\| \left( \pi_{X, \lambda}(x) \right) - y \right\| \blacksquare$$

**Следствия.** Следствия 1,2,3 применимы к отображению  $\pi_{X_{\square}, \lambda}(x)$ .

Обоснование отображения  $\tilde{\pi}_{X_{\square}, \lambda}(x)$ **Лемма 2.**

$\forall y \in X_{\square}, \forall x \mid \underline{x} \leq x \leq \bar{x}, r(x) \neq 0 \Rightarrow \|\tilde{\pi}_{X_{\square}, \lambda}(x) - y\| < \|x - y\|.$

**Доказательство.** Пусть  $\underline{x} \leq y = \underline{x} + v = \bar{x} - w \leq \bar{x}$ , где  $v, w \in \mathbb{R}^n, v, w \geq 0$ .

Рассмотрим поэлементное представление отображения  $\tilde{\pi}_{X_{\square}, \lambda}(x) = \left( \left( \tilde{\pi}_{X_{\square}, \lambda}(x) \right)_i \right).$

Можно показать, что  $\left( \tilde{\pi}_{X_{\square}, \lambda}(x) \right)_i = \begin{cases} \frac{\underline{x}_i + |(\pi_{X, \lambda}(x))_i - \underline{x}_i| + x_i}{2} & \text{при } x_i \leq \frac{\underline{x}_i + \bar{x}_i}{2} \\ \frac{\bar{x}_i - |(\pi_{X, \lambda}(x))_i - \bar{x}_i| + x_i}{2} & \text{при } x_i > \frac{\underline{x}_i + \bar{x}_i}{2} \end{cases}$

Следовательно,

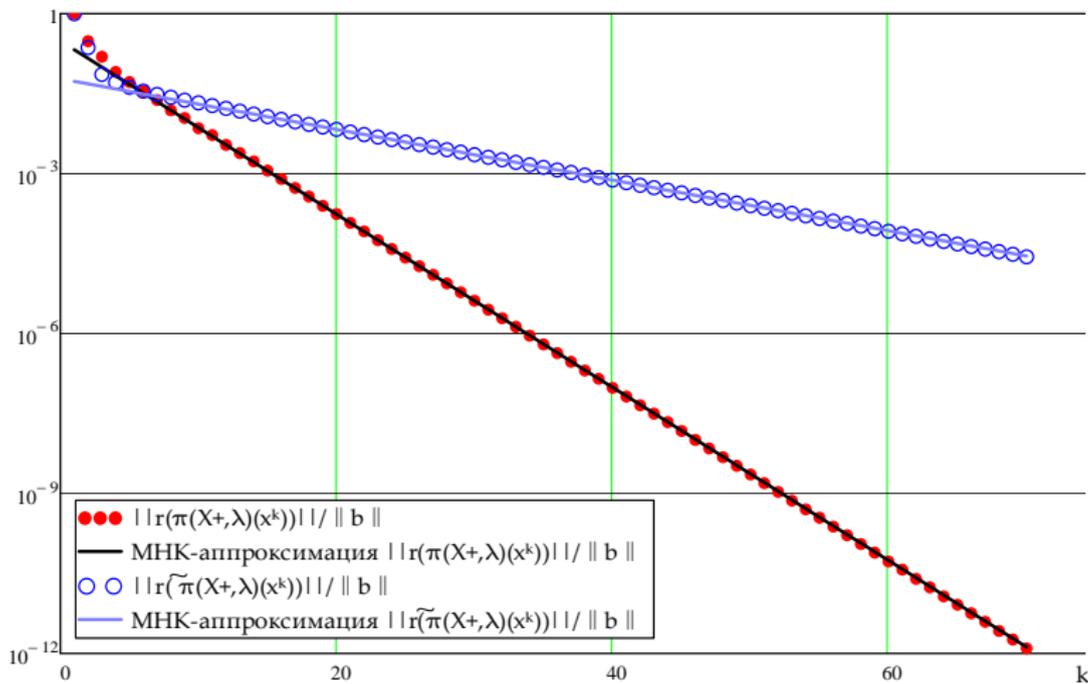
$$\left| \left( \tilde{\pi}_{X_{\square}, \lambda}(x) \right)_i - y_i \right| = \begin{cases} \frac{|(\pi_{X, \lambda}(x))_i - \underline{x}_i| - v_i + (x_i - y_i)}{2} (= \tilde{\sigma}) & \text{при } x_i \leq \frac{\underline{x}_i + \bar{x}_i}{2} \\ \frac{w_i - |(\pi_{X, \lambda}(x))_i - \bar{x}_i| + (x_i - y_i)}{2} (= \tilde{\rho}) & \text{при } x_i > \frac{\underline{x}_i + \bar{x}_i}{2} \end{cases}$$

Рассмотрим отдельно выражения  $\tilde{\sigma}$  и  $\tilde{\rho}$ :  $\tilde{\sigma}, \tilde{\rho} \leq \frac{|(\pi_{X, \lambda}(x))_i - y_i| + |x_i - y_i|}{2}.$

Таким образом,  $\left| \left( \tilde{\pi}_{X_{\square}, \lambda}(x) \right)_i - y_i \right| \leq \frac{|(\pi_{X, \lambda}(x))_i - y_i| + |x_i - y_i|}{2}$  абс. норма  $\Rightarrow$

$$\text{абс. норма} \Rightarrow \left\| \left( \tilde{\pi}_{X_{\square}, \lambda}(x) \right) - y \right\| \leq \frac{\left\| (\pi_{X, \lambda}(x)) - y \right\| + \|x - y\|}{2} < \|x - y\| \blacksquare$$

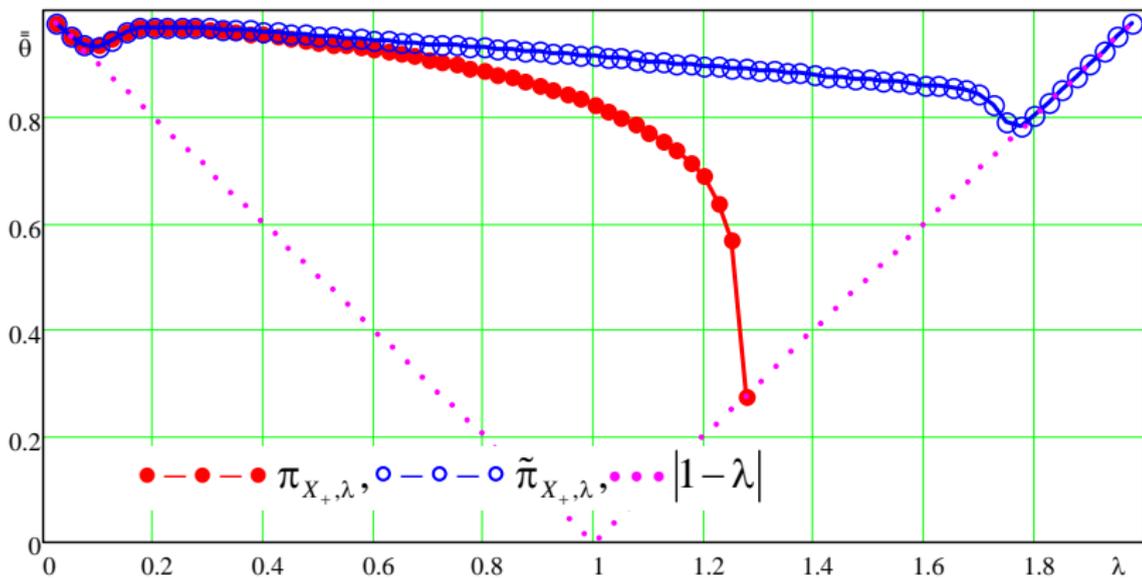
**Следствия.** Следствия 1,2,3 применимы к отображению  $\tilde{\pi}_{X_{\square}, \lambda}(x).$

Иллюстрация методики экспериментального оценивания  $\bar{\theta}$  $\lambda = 1.2$ 

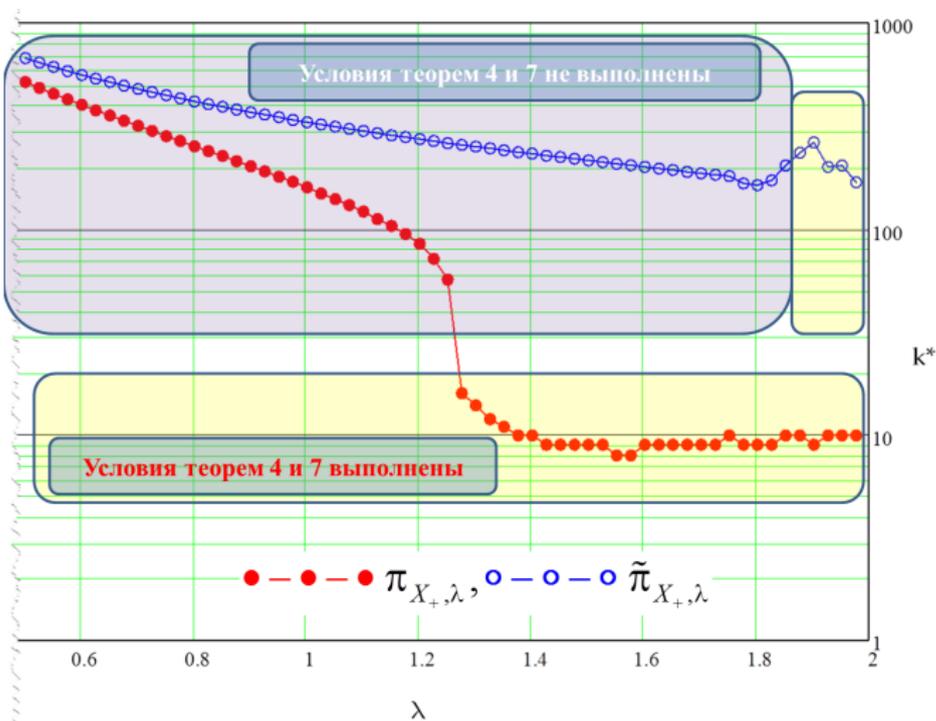
Реальный пример средней размерности:  $m = 136$ ,  $n = 285$ ,  
 $\text{rank } A = 136$ ,  $X_+ \neq \emptyset$ ,  $x^0 = 0$ . Сходимость  $\pi_{X_+,\lambda}$  VS  $\tilde{\pi}_{X_+,\lambda}$

Экспериментальная оценка  $\bar{\theta}(\lambda)$  по последовательностям  $\{x^k\}_\lambda$  и  $\{\tilde{x}^k\}_\lambda$

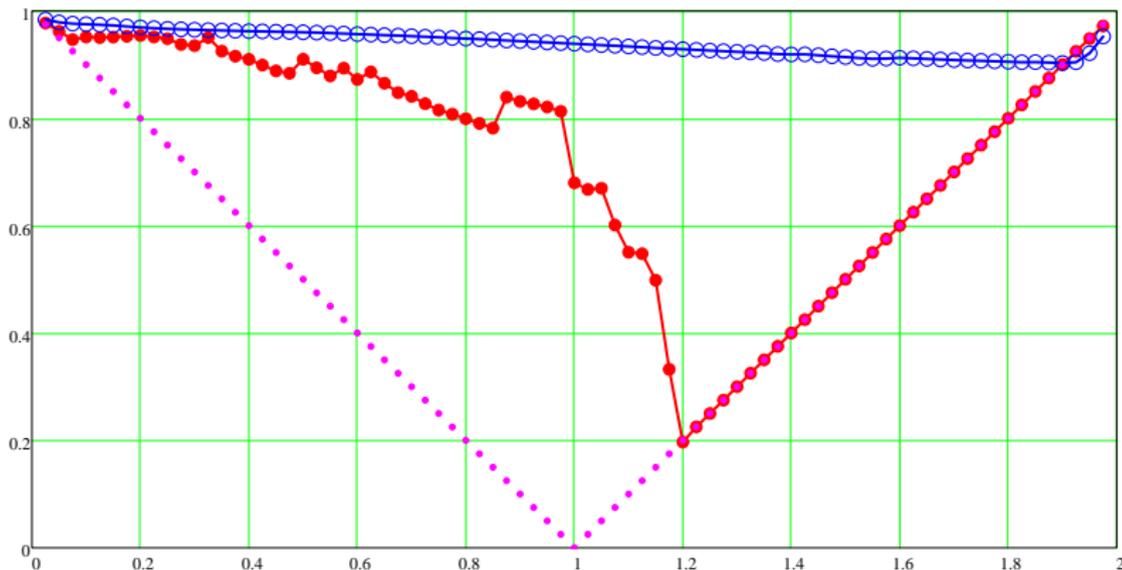
Для всех представленных на графиках данных экспериментально подтвержден первый порядок сходимости и выполнение условий  $\pi_{X,\lambda}(x) \not\geq 0 \forall x \in \{x^k\}$ ,  $\tilde{\pi}_{X,\lambda}(\tilde{x}) \not\geq 0 \forall \tilde{x} \in \{\tilde{x}^k\}$



Реальный пример средней размерности:  $m = 136$ ,  $n = 285$ ,  
 $\text{rank } A = 136$ ,  $X_+ \neq \emptyset$ ,  $x^0 = 0$ . Число шагов  $k^*$ :  $\pi_{X_+, \lambda}$  VS  $\tilde{\pi}_{X_+, \lambda}$



Реальный пример средней размерности:  $m = 136$ ,  $n = 285$ ,  
 $\text{rank } A = 136$ ,  $X_{\square} \neq \emptyset$ ,  $x^0 = 0$ . Сходимость  $\pi_{X_{\square},\lambda}$  VS  $\tilde{\pi}_{X_{\square},\lambda}$



Спасибо за внимание!  
Вопросы?

# Итерационное отображение фейеровского типа для решения системы линейных алгебраических уравнений с двухсторонними ограничениями

В.И. Ерохин

<sup>1</sup>Военно-космическая академия имени А.Ф. Можайского, Санкт-Петербург, Россия  
[vka@mil.ru](mailto:vka@mil.ru)



Семинар по оптимизации, машинному обучению  
и искусственному интеллекту «O&ML»

19 декабря 2024 г.