

УДК 517.988.68

ИТЕРАЦИОННЫЕ ФЕЙЕРОВСКИЕ ПРОЦЕССЫ В НЕКОРРЕКТНЫХ ЗАДАЧАХ

© 2020 г. В. В. Васин

620990 Екатеринбург, ул. С. Ковалевской, 16, Институт математики и механики УрО РАН;
Уральский федеральный университет, Екатеринбург, Россия

e-mail: vasin@imm.uran.ru

Поступила в редакцию 25.09.2019 г.
Переработанный вариант 25.09.2019 г.
Принята к публикации 11.02.2020 г.

Представлен краткий обзор по итерационным процессам фейеровского типа для основных постановок некорректно поставленных задач, которые включают задачи условной квадратичной и выпуклой минимизации, вариационные неравенства, линейные и нелинейные операторные уравнения в гильбертовом пространстве. Все эти постановки сводятся к задаче нахождения неподвижной точки нестягивающего фейеровского оператора на основе метода последовательных приближений и его модификации с помощью корректирующих множителей. Представлен также материал, касающийся двухэтапного метода построения регуляризующего алгоритма для нелинейных некорректных задач с монотонным оператором, излагается экономичный способ учета в алгоритме дополнительной априорной информации о решении с помощью фейеровских отображений. Библиография: 22.

Ключевые слова: фейеровский процесс, некорректно поставленная задача, регуляризующий алгоритм, аппроксимация неподвижной точки, априорная информация.

DOI: 10.31857/S0044466920060113

1. ВВЕДЕНИЕ

В небольшой заметке [1] Л. Фейер сформулировал следующее определение поточечной близости точки к некоторому множеству.

Определение 1. Пусть M – замкнутое множество из \mathbb{R}^n (или гильбертова пространства). Если для точек p и p_1 из \mathbb{R}^n выполнено неравенство $\|p - q\| > \|p_1 - q\|$ для любого $q \in M$, то будем говорить, что p_1 поточечно ближе к M , чем p . Причем, если для p не существует точек p_1 , которые поточечно ближе, чем p , тогда точку p назовем ближайшей к множеству M .

Кроме того, им было отмечено, что множество ближайших к M точек совпадает с замкнутой выпуклой оболочкой $\overline{\text{conv}(M)}$ множества M . Из этого факта непосредственно вытекает, что если точка p не принадлежит $\overline{\text{conv}(M)}$, то можно найти точку p_1 , которая поточечно ближе к множеству M , чем p .

На основе определения 1 поточечной близости точки к множеству и отмеченного геометрического факта Т. Моцкин и Дж. Шенберг [2] ввели определение монотонной фейеровской последовательности $\{x_k\}$, для которой $x_k \neq x_{k+1}$, $\|x_{k+1} - q\| \leq \|x_k - q\| \forall q \in M$, и предложили релаксационный метод решения систем линейных неравенств. Дальнейшие исследования по методам построения фейеровских последовательностей для задач линейного и выпуклого программирования были продолжены в работах [3], [4]. И.И. Ереминым были введены более общие понятия, связанные с именем Л. Фейера: фейеровский оператор, фейеровский процесс, установлены их свойства и важные факты, которые определили широкий простор для построения итерационных фейеровских методов решения задач математического программирования в \mathbb{R}^n , в том числе, нелинейных [5], [6] (см. также [7]).

В работе автора [8] было дано определение класса псевдосжимающих операторов, который в книге [8] в рамках единого подхода был переименован в класс сильно M -фейеровских операторов.

ров, поскольку эти операторы обладают более сильным свойством сжимаемости, чем фейеровские операторы, введенные И.И. Ереминым, и удовлетворяют тем же базовым условиям. Свойство сильной M -фейеровости оказалось весьма полезным при исследовании итерационных методов решения линейных и нелинейных обратных некорректных задач в бесконечномерных пространствах, что обусловлено уникальными свойствами процессов с фейеровскими операторами шага, а именно.

1. Неединственность решения задачи не является препятствием для применения (сильно) фейеровского процесса.

2. Классы фейеровских операторов замкнуты относительно операций произведения отображений и взятия выпуклой суммы.

3. Возможность решения задачи с помощью разбиения на подзадачи, для каждой из которых строится итерационный процесс с фейеровским оператором шага, и формирование итерационного метода для исходной задачи в виде суперпозиции операторов шага из числа построенных для подзадач.

4. Возможность построения гибридных итерационных методов, в которых оператор шага образуется с помощью операций произведения и выпуклой суммы операторов шага различных фейеровских итерационных схем решения исходной обратной задачи.

5. Фейеровские процессы обладают внутренним параллелизмом, следовательно, хорошо приспособлены для применения параллельных технологий.

6. Гибкий учет в алгоритме дополнительных априорных ограничений, заданных в форме линейных соотношений, и систем линейных и выпуклых неравенств с помощью фейеровских отображений.

2. ОСНОВНЫЕ КЛАССЫ ОПЕРАТОРОВ ФЕЙЕРОВСКОГО ТИПА И ИХ ВЗАИМОСВЯЗЬ

В приводимых ниже определениях классов нелинейных операторов используется двойная терминология. С одной стороны, в качестве основного понятия выступает свойство фейеровости, а с другой, в качестве сравнения привлекается терминология, которая встречается в несколько иной форме в различных разделах функционального анализа. Далее в статье мы будем использовать только ту терминологию, которая была введена в первых работах по фейеровским процессам и основана на идее поточечной аппроксимации множества, восходящей к работе [1]. Если не оговаривается особо, то в дальнейшем предполагается, что исследуемые операторы действуют в гильбертовом пространстве, для которого примем обозначение H , а через $\text{Fix}(T)$ обозначим множество неподвижных точек оператора T , т.е.

$$\text{Fix}(T) = \{x : x \in D(T) \subset H, T(x) = x\}.$$

Определение 2. Оператор $T : H \rightarrow H$ называется слабо M -фейеровским (или M -квазинерастягивающим), если $M = \text{Fix}(T) \neq \emptyset$ и выполнено неравенство

$$\|T(x) - z\| \leq \|x - z\| \quad \forall x \in H, \quad \forall z \in M,$$

обозначим класс таких операторов через \mathcal{K}_M .

Определение 3. Оператор $T : H \rightarrow H$ называется M -фейеровским (или строго M -квазинерастягивающим), если $M = \text{Fix}(T) \neq \emptyset$ и

$$\|T(x) - z\| < \|x - z\| \quad \forall x \in H, \quad x \notin M, \quad z \in M,$$

обозначаем этот класс через \mathcal{F}_M .

Определение 4. Оператор $T : H \rightarrow H$ называется сильно M -фейеровским (или M -псевдосжимающим), если $M = \text{Fix}(T) \neq \emptyset$ и существует константа ν такая, что

$$\|T(x) - z\|^2 \leq \|x - z\|^2 - \nu \|T(x) - z\|^2 \quad \forall x \in H, \quad z \in M,$$

обозначаем класс таких операторов через \mathcal{P}_M^ν .

Определение 5. Оператор $T : H \rightarrow H$ называется нерастягивающим (нерасширяющим), если выполнено неравенство

$$\|T(x) - T(v)\| \leq \|x - v\| \quad \forall x, v \in H;$$

обозначим этот класс операторов \mathcal{K} . Из определений 2–4 следует, что для введенных классов справедливы включения

$$\mathcal{P}_M^v \subset \mathcal{F}_M \subset \mathcal{K}_M,$$

причем, как показывают примеры (см. [9]), эти включения строгие. В дальнейшем при упоминании о свойстве фейеровости оператора, как правило, будут опускаться слова “слабо” и “сильно”, если из текста ясно, о каком классе фейеровских операторов идет речь. Заметим, что сильную M -фейеровость, с одной стороны, можно рассматривать как некоторое обобщение свойства псевдосжимаемости Б. Мартине [10] для нерастягивающего оператора, а с другой, как усиление свойства M -фейеровости, введенное в [6].

Лемма 1. *Если оператор $V : H \rightarrow H$ и $V \in \mathcal{K}_M$, тогда для $\lambda \in (0, 1)$ оператор $T = \lambda V + (1 - \lambda)I$ принадлежит классу \mathcal{P}_M^v для $v = (1 - \lambda)/\lambda$. Обратно, если $T \in \mathcal{P}_M^v$, то $T = \frac{1}{1+v}V + \frac{v}{1+v}I$, где $V \in \mathcal{K}_M$.*

3. ОСНОВНЫЕ ПОСТАНОВКИ НЕЛИНЕЙНЫХ НЕКОРРЕКТНЫХ ЗАДАЧ

1. Минимизация выпуклого функционала

$$\min\{\phi(x) : x \in Q\} = \phi^*, \quad (3.1)$$

где $\phi : H \rightarrow \mathbb{R}^1$ – полунепрерывный снизу выпуклый (в частности, квадратичный) функционал, Q – выпуклое замкнутое подмножество гильбертова пространства H , которое называется допустимым множеством, ϕ^* – оптимальное значение, множество M решений задачи (3.1) называется оптимальным множеством. Если ϕ – сильно выпуклый функционал, то задача (3.1) корректно поставлена по Тихонову, однако выпуклость целевого функционала не гарантирует корректность задачи.

2. Решение вариационного неравенства

$$\langle F(x), x - v \rangle \leq 0 \quad \forall v \in Q, \quad (3.2)$$

где F – оператор, действующий в гильбертовом пространстве H , Q – выпуклое замкнутое подмножество пространства H , $\langle \cdot, \cdot \rangle$ обозначает скалярное произведение в пространстве H .

3. Нахождение неподвижной точки нелинейного оператора $T : H \rightarrow H$, т.е. решение уравнения II рода

$$x = T(x). \quad (3.3)$$

4. Нахождение решения нелинейного операторного уравнения I рода

$$A(x) = y, \quad (3.4)$$

где оператор A действует на паре гильбертовых пространств, для которого обратный A^{-1} , в общем случае, разрывный.

Установим связь между базовыми постановками некорректных задач, чтобы убедиться, что все они могут быть представлены в форме (3.3) – нахождение неподвижной точки нелинейного оператора.

Теорема 1. *Для того чтобы точка x^* была решением задачи (3.1) минимизации выпуклого дифференцируемого по Гато функционала, необходимо и достаточно, чтобы точка x^* была решением вариационного неравенства*

$$\langle \nabla \phi(x), x - v \rangle \leq 0 \quad \forall v \in Q. \quad (3.5)$$

Теорема 2. *Задача (3.2), в частности, (3.5) эквивалентна решению уравнения II рода*

$$x = P_Q(x - \gamma F(x)) \equiv T(x), \quad (3.6)$$

где γ – произвольный положительный параметр, P_Q – оператор метрического проектирования на множество Q . В частности, ввиду теоремы 1, задача минимизации (3.1) эквивалентна задаче (3.6) при $F(x) = \nabla \phi(x)$, а задача (3.4) эквивалентна (3.3) при $T(x) = x + A(x) - y$.

Таким образом, базовые постановки некорректно поставленных задач 1–4 можно рассматривать с единых позиций как задачу аппроксимации неподвижной точки нелинейного отображения, т.е. решения уравнения (3.3). Однако в приложениях выбор математической модели обычно диктуется типами входных данных, свойствами операторов и наличием для данной постановки сходящихся итерационных процессов.

4. СВОЙСТВА СИЛЬНО ФЕЙЕРОВСКИХ ОПЕРАТОРОВ

Во многих случаях задача допускает разбиение на подзадачи, для каждой из которых строится итерационный оператор, а затем с помощью некоторых операций сборки из имеющихся фрагментов конструируется оператор шага итерационного метода для решения задачи в целом. При этом удается построить разрешающий оператор из того же класса, что и порождающие его операторы, отвечающие за подзадачи. Возможность использования такого подхода для фейеровских операторов из класса \mathcal{P}_M^V устанавливает следующая теорема (см. [7, теорема 1.8], [8]).

Теорема 3. Пусть операторы $T_i : H \rightarrow H$, $T_i \in \mathcal{P}_{M_i}^{V_i}$ и $M = \bigcap_{i=1}^m M_i \neq \emptyset$. Тогда верно следующее:

- 1) $T = T_m T_{m-1} \dots T_1 \in \mathcal{P}_M^V$, $v = \min_{1 \leq i \leq m} \{v_i\} / 2^{m-1}$,
- 2) $T = \sum_{i=1}^m \alpha_i T_i \in \mathcal{P}_M^V$, $\alpha_i > 0$, $\sum_{i=1}^m \alpha_i = 1$, $v = \min_{1 \leq i \leq m} \{v_i\}$.

Заметим, что порядок операторов в произведении из пункта 1 не имеет значения, т.е. соотношение справедливо для любой перестановки индексов.

Для аппроксимации неподвижных точек нелинейного оператора T , т.е. решения уравнения

$$x = T(x), \quad (4.1)$$

к которому сводятся основные постановки некорректных задач, применим метод последовательных приближений (МПП)

$$x^{k+1} = T(x^k). \quad (4.2)$$

Введем обозначения “ \rightharpoonup ” и “ \rightarrow ” для слабой и сильной сходимости элементов гильбертова пространства. Сформулируем теорему сходимости для оператора шага T из класса \mathcal{P}_M^V , которая была первоначально доказана для нестягивающего оператора [10], а затем при более общих условиях [8].

Теорема 4. Пусть оператор $T : D(T) \subset H \rightarrow H$ из класса \mathcal{P}_M^V удовлетворяет соотношению

$$x_j \rightharpoonup x, \quad x_j - T(x_j) \rightarrow 0 \Rightarrow x \in \text{Fix}(T) = M. \quad (4.3)$$

Тогда при любом x^0 для итерационного процесса (4.2) справедливы следующие свойства:

- 1) $x^k \rightharpoonup \hat{x} \in \text{Fix}(T)$, т.е. сходится слабо к решению уравнения (4.1);
- 2) $\inf\{\lim_{k \rightarrow \infty} \|x^k - z\| : z \in \text{Fix}(T)\} = \lim_{k \rightarrow \infty} \|x^k - \hat{x}\|$;
- 3) либо $\|x^{k+1} - \hat{x}\| < \|x^k - \hat{x}\|$ для любого k , либо x^k стационарна, начиная с некоторого $k_0 \geq 0$, т.е. $x^{k_0} = x^{k_0+1} = \dots = \hat{x}$;
- 4) справедлива оценка

$$\sum_{k=0}^{\infty} \|x^{k+1} - x^k\|^2 \leq \|x^0 - z\|^2 / v \quad \forall z \in \text{Fix}(T).$$

С учетом леммы 1 из теоремы 4 получаем

Следствие 1. Пусть в условиях теоремы вместо $T \in \mathcal{P}_M^V$ выполнено $T \in \mathcal{K}_M$. Тогда заключение теоремы справедливо для процесса

$$x^{k+1} = \lambda T(x^k) + (1 - \lambda)x^k,$$

где $0 < \lambda < 1$.

Замечание 1. Если дополнительно в теореме 4 оператор T является нестягивающим (определение 5), тогда условие (4.3) выполнено. Таким образом, если множество $M = \bigcap_{i=1}^m M_i \neq \emptyset$ и известны операторы $T_i \in \mathcal{P}_{M_i}^{\nu_i}$, то, согласно теореме 3, для построения оператора $T \in \mathcal{P}_M^{\nu}$ достаточно положить

$$T = T_m T_{m-1} T \dots T_1, \quad T = \sum_{i=1}^m \alpha_i T_i, \quad (4.4)$$

где $\alpha_i > 0$, $\sum_{i=1}^m \alpha_i = 1$. Объединяя этот факт с теоремой 4, получаем утверждение о сходимости МПП с оператором шага T из (4.4).

Теорема 5. Пусть $M = \bigcap_{i=1}^m M_i \neq \emptyset$, $T_i \in \mathcal{P}_{M_i}^{\nu_i}$ и для каждого выполнено условие (4.3). Тогда для МПП (4.2), где T – любой из операторов (4.4), справедливо заключение теоремы 4.

Необходимо отметить, что, хотя сходимость итераций в теоремах 4, 5 только слабая, полученные результаты и развитые подходы можно применять при решении конечномерных задач, например, для систем линейных алгебраических уравнений (СЛАУ), в том числе, плохообусловленных

$$Ax = y, \quad x \in \mathbb{R}^n, \quad y \in \mathbb{R}^s, \quad (4.5)$$

где матрица A – произвольной структуры, а система, в общем случае, разрешима лишь в смысле наименьших квадратов. Во-первых, на примере СЛАУ легко продемонстрировать возможность разбиения на подзадачи (подсистемы), для каждой из которых строится фейеровский оператор, порождающий итерационный процесс, а затем из этих операторов генерируется фейеровский итерационный процесс для решения исходной СЛАУ (4.5) с помощью операций, указанных в теореме 3. В качестве подзадач здесь выступают подсистемы, на которые можно произвольным образом разрезать исходную СЛАУ. Во-вторых, покажем, как можно учитывать в алгоритме априорную информацию о решении СЛАУ с помощью фейеровских отображений.

Рассмотрим два итерационных метода решения СЛАУ – метод простой итерации и итерированный вариант метода Тихонова:

$$x^{k+1} = x^k - ((A^T A x^k - A^T y) \equiv T(x^k)), \quad \|A\| \leq 1, \quad (4.6)$$

$$x^{k+1} = x^k - (A^T A + \alpha I)^{-1} (A^T y + \alpha x^k) \equiv T(x^k). \quad (4.7)$$

Предположим, что известна дополнительная априорная информация о решении СЛАУ (4.5) в форме систем выпуклых (в частности, линейных) неравенств

$$x \in Q = \{x \in \mathbb{R}^n : f_i(x) \leq 0, i = 1, 2, \dots, m\}. \quad (4.8)$$

Определим операторы

$$U_i(x) = x - \lambda \frac{f_i^+(x) \nabla f_i(x)}{\|\nabla f_i(x)\|^2}, \quad 0 < \lambda < 2, \quad (4.9)$$

где f_i – слабо полунепрерывный снизу функционал с ограниченным градиентом ∇f_i , и образуем с помощью операций умножения и выпуклой суммы операторы

$$U(x) = U_m U_{m-1} U \dots U_1(x), \quad U(x) = \sum_{i=1}^m \alpha_i U_i(x). \quad (4.10)$$

Оказывается, что каждый из операторов шага T , определяемый процессами (4.6), (4.7), принадлежат классу \mathcal{P}_M^1 , где M – множество решений СЛАУ (4.5) в смысле наименьших квадратов, оператор U_i , определяемый формулой (4.9), принадлежит $\mathcal{P}_{Q_i}^{\nu}$, где $\nu = (2 - \lambda)/\lambda$, (см. [7], лемма 3.14), а множество Q_i определяется i -м неравенством в системе (4.8). Следовательно, оператор U , определяемый каждой из формул (4.10), принадлежит классу \mathcal{P}_Q^{ν} при соответствующем ν (см. теорему 3). Поэтому из теоремы 5 получаем

Следствие 2. Для любого x^0 последовательность x^k , генерируемая фейеровским процессом

$$x^{k+1} = U(T(x^k)),$$

где U — любой из операторов (4.10), сходится к решению СЛАУ (4.5) в смысле наименьших квадратов, удовлетворяющему априорным ограничениям (4.8).

Замечание 2. Если априорное множество Q задано системой линейных неравенств, то при возмущенных входных данных СЛАУ и системы неравенств итерационный метод порождает регуляризирующий алгоритм (РА). В [7], [9] можно найти доказательство приведенных здесь фактов и примеры использования априорных ограничений при решении прикладных задач.

5. МОДИФИКАЦИЯ МПП НА ОСНОВЕ КОРРЕКТИРУЮЩИХ МНОЖИТЕЛЕЙ

Цель этого раздела — исследование модифицированного варианта МПП, с помощью которого удастся получить сильную сходимость итераций для нестягивающего оператора и его приложений к некорректно поставленным задачам. Следующие две теоремы, полученные в работе Ф. Браудера [11], касаются существования неподвижных точек нестягивающего оператора и их устойчивости относительно параметра.

Теорема 6. Пусть D — выпуклое замкнутое ограниченное множество гильбертова пространства H и T — нестягивающий оператор (определение 5), действующий из D в D . Тогда множество неподвижных точек $\text{Fix}(T)$ не пусто, выпукло и замкнуто.

Рассмотрим уравнение

$$x = \gamma T(x) + (1 - \gamma)v_0 \quad (5.1)$$

с оператором $T \in \mathcal{K}$ и $0 < \gamma < 1$, где v^0 — некоторый элемент из D .

Теорема 7. Пусть $T : H \rightarrow H$ — нестягивающий оператор (определение 5), отображающий выпуклое замкнутое ограниченное подмножество D из H в D . Тогда для любого $v^0 \in D$ и параметра $0 < \gamma < 1$ существует единственное решение $x_\gamma \in D$ уравнения (5.1) и $\lim_{\gamma \rightarrow 1} \|x_\gamma - \hat{x}\| = 0$, где \hat{x} — ближайшая к v^0 неподвижная точка оператора T .

Б. Гальперин в своей статье [12] предложил модифицированный вариант МПП в форме

$$x^{k+1} = \gamma_{k+1} T(x^k) + (1 - \gamma_{k+1})v_0 \quad (5.2)$$

и, используя результаты работы [11], установил сильную сходимость итераций к некоторой точке из $\text{Fix}(T)$. Для формулировки теоремы сходимости нам понадобится определение допустимой последовательности γ_i .

Определение 6. Числовая последовательность γ_i называется допустимой, если следующие условия выполняются:

- 1) $0 < \gamma_i < 1$, $i = 1, 2, \dots$;
- 2) $\gamma_i < \gamma_{i+1}$, $i = 1, 2, \dots$, $\lim_{i \rightarrow \infty} \gamma_i = 1$ и справедливы соотношения:
- 3) существует последовательность номеров $n(i)$ такая, что $n(i+1) > n(i)$ и справедливы соотношения:
- 4) $\lim_{i \rightarrow \infty} \varepsilon_{i+n(i)} \varepsilon_i^{-1} = 1$, где $\varepsilon_i = 1 - \gamma_i$;
- 5) $\lim_{i \rightarrow \infty} n(i) \varepsilon_i = \infty$.

Теорема 8. Пусть выполнены условия теоремы 7. Тогда для любого начального приближения $x^0 \in D$ и для любой допустимой последовательности γ_k последовательность x^k , порождаемая процессом (5.2), сходится сильно к $\hat{x} \in \text{Fix}(T)$, ближайшей к v_0 .

Замечание 3. Если в теореме 8 наряду с условием $T \in \mathcal{K}$ оператор принадлежит классу \mathcal{P}_M^V (или даже \mathcal{K}_M), то в качестве множества D можно взять шар $\mathcal{S}(z; r)$ произвольного радиуса r с центром в неподвижной точке z , содержащий v_0 . Это означает, что сходимость итерационного метода (5.2) будет гарантирована для любой начальной точки x^0 .

Замечание 4. Последовательность $\gamma_i = 1 - i^{-p}$ при $0 < p < 1$ и $n(i) = i^v$, $0 < p < v < 1$ является допустимой в смысле определения 6. Как было отмечено в разд. 3, основные постановки некорректных задач могут быть сведены к нахождению неподвижной точки некоторого отображения на основе МПП (4.2) или его модифицированного аналога (5.2). Следовательно, в случае возмущенных данных задачи с уровнем погрешности δ необходимо формулировать правило останова итераций, которое бы гарантировало сильную сходимость $x^{k(\delta)} \rightarrow \hat{x} \in \text{Fix}(T)$.

Исследуем регуляризующие свойства итерационного процесса (5.2). Рассмотрим наряду с (5.2) ее аналог с возмущенным оператором \tilde{T}

$$\tilde{x}^{k+1} = \gamma_{k+1} \tilde{T}(\tilde{x}^k) + (1 - \gamma_{k+1})v_0 \quad (5.3)$$

и с той же стартовой точкой x^0 . Введем параметр δ , который характеризует ошибку входных данных задачи так, что выполнено одно из двух соотношений

$$\|\tilde{T}(\tilde{x}^k) - T(\tilde{x}^k)\| \leq \phi(\delta), \quad k = 0, 1, \dots, \quad (5.4)$$

$$\|\tilde{T}(x^k) - T(x^k)\| \leq \phi(\delta), \quad k = 0, 1, \dots, \quad (5.5)$$

где $\phi(\delta) \rightarrow 0$ при $\delta \rightarrow 0$.

Теорема 9. Пусть выполнены условия теоремы 8 и имеет место либо соотношение (5.4), либо (5.5), причем в последнем случае дополнительно предполагается, что $\tilde{T} \in \mathcal{K}$. Тогда при связи параметров $k(\delta)\phi(\delta) \rightarrow 0$, $\delta \rightarrow 0$, последовательность $\tilde{x}^{k(\delta)}$, сформированная процессом (5.3), сходится к $\hat{x} \in \text{Fix}(T)$, ближайшей к v_0 .

6. ПРИЛОЖЕНИЯ МПП С КОРРЕКТИРУЮЩИМИ МНОЖИТЕЛЯМИ

Обратимся к уравнению (4.5) и рассмотрим процессы (4.6), (4.7), где теперь вместо матрицы линейный ограниченный оператор A , действующий на паре гильбертовых пространств, обратный оператор A^{-1} которого в общем случае разрывный. Нетрудно проверить, что оператор шага в каждом из этих процессов является нерастягивающим, поэтому из теоремы 8 получаем

Следствие 3. Итерационный процесс (5.2), где T – оператор шага любого из процессов (4.6), (4.7), сходится сильно к решению, в общем случае, в смысле наименьших квадратов, ближайшему к v_0 .

Пусть вместо точной пары (A, y) известны приближенные данные A_δ, y_δ такие, что $\|A - A_\delta\| \leq \delta$, $\|y - y_\delta\| \leq \delta$. Несложная проверка показывает, что в этом случае выполнены соотношения (5.4), (5.5) с функцией $\phi(\delta) = c\delta$, где c – некоторая константа, следовательно, из теоремы 9 имеем

Следствие 4. При связи параметров $k(\delta)\delta \rightarrow 0$, $\delta \rightarrow 0$ последовательность $\tilde{x}^{k(\delta)}$, построенная процессом (5.3) с возмущенными данными A_δ, y_δ сходится к решению операторного уравнения (4.5), ближайшему к v_0 . Аналогичное утверждение справедливо для процесса

$$x^{k+1} = \gamma_{k+1} U(T(x^k)) + (1 - \gamma_k)v_0, \quad (6.1)$$

где $U \in \mathcal{P}_Q^v \cap \mathcal{K}$, $M \cap Q \neq \emptyset$ при наличии априорной информации о решении операторного уравнения в виде $x \in Q$.

В качестве примера множества априорных ограничений для операторного уравнения рассмотрим систему линейных неравенств

$$Q = \{x \in H : l_i(x) \equiv \langle x, a_i \rangle - q_i \leq 0\} \quad (6.2)$$

и оператор, отвечающий за i -е неравенство

$$U_i(x) = x - \lambda \frac{l_i^+ a_i}{\|a_i\|}, \quad 0 < \lambda < 2. \quad (6.3)$$

Справедлива следующая [7]

Лемма 2. *Оператор U_i принадлежит классу $\mathcal{P}_{Q_i}^v \cap K$, т.е. является сильно фейеровским и нестягивающим; здесь $Q_i = \{x \in H: \langle x, a_i \rangle - q_i \leq 0\}$, $v = (2 - \lambda)/\lambda$.*

Это означает, что в качестве оператора U в процессе (6.1) можно принять оператор, образованный произведением или выпуклой суммой операторов U_i . Заметим, что при $\lambda = 1$ оператор U_i совпадает с метрической проекцией на гиперплоскость $l_i(x) = 0$.

В приложениях часто используется априорная информация о неотрицательности, монотонности или выпуклости решения в разных сочетаниях. Вместе с ограниченностью эти свойства порождают компактные множества, например, в L_p . После дискретной аппроксимации априорные ограничения принимают вид выпуклых многогранников. В монографии [13] разработаны специальные методы, алгоритмы и программные средства построения регуляризованного семейства приближенных решений для линейных некорректных задач с учетом априорных ограничений такого типа.

Рассмотрим сначала частный случай задачи (3.1), когда целевой функционал – квадратичный

$$\min \{ \|Ax - y\|^2 : x \in Q \}, \quad (6.4)$$

где A – линейный ограниченный оператор, действующий на паре гильбертовых пространств H_1, H_2 , а Q – выпуклое замкнутое необязательно компактное подмножество из H_1 . Поскольку компактность множества не предполагается и допускается неограниченность обратного оператора A^{-1} , то задача некорректна по Тихонову. Предполагается, что задача (6.4) имеет непустое множество решений M . Согласно теоремам 1, 2 задача (6.4) эквивалентна решению операторного уравнения

$$x = P_Q[x - \beta(A^*Ax - A^*y)] \equiv T(x),$$

где P_Q – оператор метрического проектирования. Сформируем МПП с оператором шага T

$$x^{k+1} = P_Q[x^k - \beta(A^*Ax^k - A^*y)] \equiv T(x^k), \quad (6.5)$$

который называют обычно методом проекций градиента. При принятых условиях нельзя гарантировать сходимость итераций к решению задачи, однако его модификация с помощью корректирующих множителей позволяет решить эту проблему, поскольку оператор шага обладает свойством фейеровости и принадлежит классу \mathcal{K} нестягивающих операторов [14] (см. также лемму 2.14 из [10]).

Лемма 3. *При $0 < \beta < 2\|A\|^{-1}$ оператор шага T итерационного метода (6.5) принадлежит классу $\mathcal{P}_{Q_i}^v \cap K$, где параметр $v = (1/\beta\|A\|^2 - 1/2)$.*

Из теоремы 8, леммы 3 и замечания 3 выводим

Следствие 5. Если последовательность γ_k является допустимой, то для любого начального приближения x^0 процесс

$$x^{k+1} = \gamma_{k+1}P_Q[x^k - \beta(A^*Ax^k - A^*y)] + (1 - \gamma_{k+1})v_0, \quad (6.6)$$

сходится к решению \hat{x} задачи (6.4), ближайшему к v_0 .

Замечание 5. Если пара (A, y) задана своим δ -приближением (A_δ, y_δ) , то для процесса (6.6) справедливо заключение следствия 4 о сходимости итераций к решению \hat{x} при выборе числа итераций $k(\delta)$ таким образом, чтобы $k(\delta)\delta \rightarrow 0$ при $\delta \rightarrow 0$.

Рассмотрим теперь задачу минимизации выпуклого функционала в общей форме (3.1). Из теорем 1, 2 следует, что решение задачи (3.1) сводится к нахождению неподвижной точки оператора

$$T(x) = P_Q(x - \gamma F(x)), \quad \gamma > 0, \quad (6.7)$$

где $F(x) = \nabla\phi(x)$, Q – выпуклое замкнутое ограниченное подмножество из H , P_Q – оператор метрического проектирования. Справедливо следующее утверждение (см. [15, лемма 4.1]).

Лемма 4. *Если $\|F'(x)\| \leq N$, $x \in Q$, то при $0 < \gamma \leq 2/N$ оператор T , определяемый формулой (6.7), является нестягивающим.*

Из теоремы 8 и леммы 4 получаем

Следствие 6. Пусть выполнены условия леммы 4 и задача (3.1) имеет непустое множество решений. Тогда для любого v_0 и для любой допустимой последовательности γ_k процесс

$$x^{k+1} = \gamma_{k+1}P_Q(x^k - \gamma\nabla\phi(x^k)) + (1 - \gamma_{k+1})v_0 \quad (6.8)$$

сильно сходится к решению задачи (3.1), ближайшему к v_0 .

Заметим, что при $\gamma_k = \frac{1}{1 + (1+k)^p}$, $0 < p < 1$, $v_0 = 0$ утверждение о сильной сходимости (6.8) содержится в работе [14] (см. теорему 4.1).

Установим регуляризующие свойства построенного итерационного процесса.

Теорема 10. Пусть целевой функционал ϕ в задаче (3.1) задан приближенно функционалом ϕ_δ и выполнены условия аппроксимации

$$\|\nabla\phi(x) - \nabla\phi_\delta(x)\| \leq \delta \quad \forall x \in Q. \quad (6.9)$$

Пусть последовательность $\{x^{k(\delta)}\}$ построена процессом (6.8), в котором функционал ϕ заменен на ϕ_δ . Тогда при выборе числа итераций $k(\delta)$, удовлетворяющему соотношению $k(\delta)\delta \rightarrow 0$ при $\delta \rightarrow 0$, последовательность $\{x^{k(\delta)}\}$ сходится к решению \hat{x} задачи (3.1), ближайшему к v_0 .

Действительно, по теореме 9 для сходимости итераций в условиях возмущенных данных достаточно проверить для оператора $T(x) = P_Q(x - \gamma F(x))$ выполнение условия (5.4), которое в нашем случае, с учетом (6.9), принимает вид

$$\|T(x) - \tilde{T}(x)\| = \|P_Q(x - \gamma\nabla\phi(x)) - P_Q(x - \gamma\nabla\phi_\delta(x))\| \leq \|\nabla\phi(x) - \nabla\phi_\delta(x)\| \leq \delta.$$

Прокс-метод позволяет аппроксимировать решение некорректной задачи минимизации выпуклого функционала (3.1) последовательностью решений корректно поставленных задач с равномерно выпуклым целевым функционалом, которые эффективно решаются традиционными методами.

Определение 7. Отображение $S_Q^\phi: H \rightarrow Q \subset H$, определяемое соотношением

$$S_Q^\phi: v \rightarrow \operatorname{argmin}\{\phi(x) + (1/2)\|x - v\|^2: x \in Q\},$$

введенное Дж. Моро [16], называется прокс-отображением, а итерационный процесс

$$x^{k+1} = S_Q^\phi(x^k)$$

называется прокс-методом; здесь Q – выпуклое замкнутое подмножество гильбертова пространства H .

Теорема 11. Прокс-отображение S_Q^ϕ принадлежит классу $\mathcal{P}_M^1 \cap \mathcal{H}$, т.е. является сильно M -фейеровским и нерастягивающим оператором, где M – множество решений задачи (3.1).

Теорема 8 вместе с теоремой 11 влекут (см. [9, лемма 2.7])

Следствие 7. Пусть задача (3.1) разрешима и \hat{x} – ее решение, ближайшее к v_0 . Тогда для $x^0 \in Q$ и допустимой последовательности γ_k процесс

$$x^{k+1} = \gamma_{k+1}S_Q^\phi(x^k) + (1 - \gamma_{k+1})v_0 \quad (6.10)$$

сходится сильно к \hat{x} .

Необходимо отметить, что при реализации процесса (6.10) требуется вычислять $w = S_Q^\phi(v)$ в каждой итерационной точке $v = x^k$, где прокс-отображение задано неявно и элемент w находится как решение задачи на минимум для равномерно выпуклого функционала. Это означает, что для приближенного вычисления $w = S_Q^\phi(v)$ можно привлечь МПП со сжимающим оператором. Действительно, согласно теоремам 1, 2 вычисление w сводится к нахождению неподвижной точки оператора $T = P_Q(x - \gamma F(x))$, т.е. к решению уравнения

$$x = P_Q(x - \gamma F(x)) \equiv T(x),$$

где $F(x) = \nabla\phi(x) + (x - v)$.

Лемма 5. Пусть $\|F(x) - F(u)\| \leq C\|x - u\|$, тогда при $\gamma < 2/C^2$, $\|T(x) - T(u)\| < \|x - v\|$, а при $\gamma = 1/C^2$, $C > 1$, справедлива оценка

$$\|T(x) - T(u)\| \leq \sqrt{1 - (1/C^2)}\|x - v\|.$$

Таким образом, для приближенного вычисления $S_Q^\phi(x^k)$ в процессе (6.10) можно применить МПП со сжимающим оператором T . Если структура множества допускает экономичный алгоритм вычисления метрической проекции P_Q , то в целом процесс (6.10) может оказаться вполне эффективным.

7. ДВУХЭТАПНЫЕ МЕТОДЫ РЕШЕНИЯ НЕЛИНЕЙНЫХ УРАВНЕНИЙ С МОНОТОННЫМ ОПЕРАТОРОМ

Регуляризованное семейство приближенных решений для вариационного неравенства (3.2) может быть сформировано на основе принципа итеративной регуляризации А.Б. Бакушинского с помощью итерационной схемы [15]

$$x^{k+1} = P_Q[x^k - \gamma_k(F(x^k) + \varepsilon_k G(x^k))], \tag{7.1}$$

где $F(x)$ – монотонный оператор, G – равномерно (сильно) монотонный оператор, P_Q – оператор метрического проектирования, γ_k, ε_k – последовательности положительных параметров. Таким образом, идея итеративной регуляризации основана на предварительной регуляризации (первый этап) исходной задачи (в данном случае вариационного неравенства) и на втором этапе на применении к ней той или иной итерационной схемы (в данном случае МПП).

Теорема 12. Пусть $F(x) = A(x) - y$, A – монотонный оператор, для которого $\sup\{\|A'(x)\|: x \in Q\} \leq C$, y задан приближенно элементом y_δ , $\|y - y_\delta\| \leq \delta$. Пусть параметры γ_k, ε_k выбраны в соответствии с соотношениями

$$0 < \varepsilon \leq 1, \quad \lim_{k \rightarrow \infty} \varepsilon_k = 0, \quad \sum_{k=1}^{\infty} \varepsilon_k^2 = \infty, \\ \gamma_k = \theta \varepsilon_k, \quad 0 < \theta \leq \frac{1}{1 + C^2}, \quad \lim_{k \rightarrow \infty} \frac{\varepsilon_{k+1} - \varepsilon_k}{\varepsilon_k^4} = 0.$$

Если число итераций $k(\delta)$ выбрано так, что выполнены соотношения $\lim_{\delta \rightarrow 0} k(\delta) = \infty$, $\lim_{\delta \rightarrow 0} \delta/\varepsilon_{k(\delta)} = 0$, то

$$\lim_{\delta \rightarrow 0} \sup_{\|y - y_\delta\| \leq \delta} \|x_\delta^{k(\delta)} - \hat{x}\| = 0,$$

где $x_\delta^{k(\delta)}$ определяется процессом (7.1), в котором y заменен на y_δ , а \hat{x} – решение вариационного неравенства $\langle G(x), x - v \rangle \leq 0 \quad \forall v \in M$, M – множество решений вариационного неравенства (3.2).

Выше уже исследовалась некорректная задача с монотонным оператором в форме вариационного неравенства и итеративно регуляризованный метод последовательных приближений, который порождает регуляризованное семейство приближенных решений. Ниже рассмотрим некорректную задачу в форме операторного уравнения (3.4), где $A : H \rightarrow H$, – монотонный оператор с разрывным обратным A^{-1} , правая часть задана приближенно $y_\delta, \|y - y_\delta\| \leq \delta$. Для построения устойчивого приближенного решения на первом этапе к операторному уравнению применяется схема Лаврентьева

$$S_\alpha \equiv A(x) + \alpha(x - v_0) - y_\delta = 0, \tag{7.2}$$

а на втором для аппроксимации регуляризованного решения x_α используются κ -процессы

$$x^{k+1} = x^k - \beta \frac{\langle (A'(x^0) + \alpha I)^\kappa S_\alpha(x^k), S_\alpha(x^k) \rangle}{\langle (A'(x^0) + \alpha I)^{\kappa+1} S_\alpha(x^k), S_\alpha(x^k) \rangle} S_\alpha(x^k), \tag{7.3}$$

где $\beta > 0$, $-1 \leq \kappa < \infty$. Класс итерационных методов (7.3) как для корректно, так и некорректно поставленной задачи (3.4) в случае нелинейных уравнений ранее не исследовались. Эти методы, по-видимому, впервые были анонсированы автором в работе [17]. Для линейного оператора A итерационные схемы вида (7.3) (естественно, при замене оператора A' на A) и при $\beta = 1$, исследо-

вались в книге [15], где при некотором выборе $\alpha_{k(\delta)}$ доказана сходимость итераций к нормальному решению уравнения (3.4). Очевидно, что для положительно-определенного оператора A при $\alpha = 0, \beta = 1, \kappa = \alpha$ схемы сводятся к классическим α -процессам, изложенным в монографии [18]. Обычно в линейном случае вместо κ используется параметр α , что дало основание назвать схемы α -процессами. Но поскольку в нашем нелинейном регуляризованном случае через α обозначен параметр регуляризации, было принято использовать в схемах (7.3) вместо привычного α параметр κ и назвать их κ -процессами.

Теорема 13. Пусть A – монотонный оператор, $A'(x^0)$ – самосопряженный (неотрицательно определенный) оператор и выполнены условия

$$\|A'(x^0)\| \leq N_0, \quad \|A(x) - A(v)\| \leq N\|x - v\| \quad \forall x, v \in S_{r_0}(u^0),$$

где $S_{r_0}(u^0)$ содержит x_α . Тогда для любого начального приближения $x^0 \in S_{r_0}(u^0)$ при

$$\beta < 2\alpha^3 / (N_0 + \alpha)(N + \alpha)^2$$

последовательность $\{x^k\}$, порождаемая процессом (7.3), сходится к решению x_α уравнения (7.2), а при

$$\beta = \alpha^3 / (N_0 + \alpha)(N + \alpha)^2$$

справедлива оценка

$$\|x^k - x_\alpha\| \leq q^k \|x^0 - x_\alpha\|, \quad q = \left[1 - \frac{\alpha^4}{(N_0 + \alpha)^2 (N + \alpha)^2} \right]. \quad (7.4)$$

Для получения оценки погрешности двухэтапного метода зададим класс корректности (равномерной регуляризации) в форме истокообразной представимости решения

$$v_0 - \hat{x} = A'(\hat{x})v, \quad \|v\| \leq r.$$

Введем переобозначение для решения регуляризованного уравнения (7.2), теперь x_α^δ обозначаем решение с приближенной правой частью y_δ , а x_α в случае точно заданной y . Согласно результату из работы [19] для регуляризованного решения справедлива оценка

$$\|x_\alpha^\delta - x_\alpha\| \leq \frac{\delta}{\alpha}, \quad \|x_\alpha - \hat{x}\| \leq \left(r + \frac{N_2 r^2}{2} \right) \alpha,$$

из которой при $\alpha = \sqrt{\delta/k_0}$ имеем

$$\|x_{\alpha(\delta)} - \hat{x}\| \leq 2\sqrt{k_0\delta}, \quad k_0 = (1 + N_2 r/2)r. \quad (7.5)$$

Объединяя (7.5) с оценкой для κ -процесса (7.4) и выбирая число итераций по формуле

$$k(\delta) = \lceil \ln(2\sqrt{k_0\delta}/r_0) / \ln q(\delta) \rceil,$$

получаем окончательную оценку для двухэтапного метода

$$\|x_{\alpha(\delta)}^{\delta, k(\delta)} - \hat{x}\| \leq 4\sqrt{k_0\delta}, \quad (7.6)$$

которая является оптимальной по порядку δ (см. подробности в [20], [21]).

Рассмотрим двухэтапный метод решения нелинейного уравнения (3.4) с монотонным непрерывно дифференцируемым оператором $A : H \rightarrow H$, для которого выполнены условия

$$\|A'(x)\| \leq N_1, \quad \|A'(x) - A'(v)\| \leq N_2\|x - v\| \quad (7.7)$$

в шаре $S_{r_0}(u^0)$, содержащем v_0 – нормальное решение уравнения (3.4) и решение x_α уравнения (7.2). Как и в предыдущем пункте, применяется схема регуляризации Лаврентьева, а на втором для аппроксимации x_α регуляризованный модифицированный метод Ньютона [20]

$$x^{k+1} = x^k - \beta[A'(x^0) + \bar{\alpha}I]^{-1}S_\alpha(x^k) \equiv T(x^k). \quad (7.8)$$

Теорема 14. Пусть производная $A'(x^0)$ является самосопряженным (неотрицательно определенным) оператором и выполнены условия (7.7). Пусть параметры $\alpha, \bar{\alpha}$ и начальное приближение x^0 удовлетворяют соотношениям:

$$\|x_\alpha - x^0\| \leq r_0, \quad 0 < \alpha \leq \bar{\alpha}, \quad r_0 = \alpha/(4N_2), \quad \bar{\alpha} \geq 3N_1.$$

Тогда при $\beta < \alpha\bar{\alpha}/(\alpha + N_1)^2$ процесс (7.8) сходится к x_α и оператор шага T является сильно $\{x_\alpha\}$ -фейеровским, а при $\beta = \alpha\bar{\alpha}/2(\alpha + N_1)^2$ справедлива оценка погрешности

$$\|x^k - x_\alpha\| \leq q^k r_0, \quad q = \left[1 - \frac{\alpha^2}{4(\alpha + N_1)^2} \right]^{1/2}, \quad (7.9)$$

где x_α — единственное решение уравнения (7.2).

Из изложенного в теореме 13 следует, что на том же классе корректности истокообразно представимых решений и при условиях теоремы 14 для двухэтапного метода Ньютона—Лаврентьева (7.2), (7.8) также справедлива оптимальная по порядку оценка (7.6) с той лишь разницей, что теперь параметр q определяется формулой (7.9).

Замечание 6. Ввиду известного факта, что градиент выпуклого функционала является монотонным оператором (см. [22, лемма 4.10, § 4, гл. III]) K -процессы и регуляризованный метод Ньютона могут применяться при аппроксимации регуляризованного решения с выпуклым функционалом Тихонова

$$\min\{\phi(x) + \alpha\Omega(x): x \in H\},$$

в частности, для квадратичного функционала $\phi(x) = \|Ax - y\|^2$ и стабилизатора $\Omega(x) = \int_D \sqrt{|\nabla x(s)|^2 + \beta} ds$.

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

1. Fejér L. Über die Lage der Nullstellen von Polynomen, die aus Minimumforderungen gewisser Art entspringen // Math. Ann. 1922. V. 85. Nr 1. S. 41–48.
2. Motzkin T.S., Schoenberg J.J. The relaxation method for linear inequalities // Canad. J. Math. 1954. V. 6. № 3. P. 393–404.
3. Agmon S. The relaxation method for linear inequalities // Canad. J. Math. 1954. V. 6. № 3. P. 382–392.
4. Бреган Л.М. Нахождение общей точки выпуклых множеств методом последовательного проектирования // ДАН СССР. 1965. Т. 162. № 3. С. 487–490.
5. Еремин И.И. Обобщение релаксационного метода Моцкина–Агмона // Успехи матем. наук. 1965. Т. 20. Вып. 2. С. 183–187.
6. Еремин И.И. Методы фейеровских приближений в выпуклом программировании // Матем. заметки. 1968. Т. 3. Вып. 2. С. 217–234.
7. Vasin V.V., Eremin I.I. Operators and iterative processes of Fejér type. Theory and applications. Berlin-New York: Walter de Gruyter, 2009.
8. Васин В.В. Итерационные методы решения некорректных задач с априорной информацией в гильбертовых пространствах // Ж. вычисл. матем. и матем. физ. 1988. Т. 28. № 7. С. 971–980.
9. Васин В.В., Агеев А.Л. Некорректные задачи с априорной информацией. Екатеринбург: УИФ “Наука”, 1993.
10. Martinet B. Determination approchée d’un point fixe d’une application pseudo-contraction. Cas de l’application // C. R. Acad. Sci. Paris. Ser. A-B. 1972. V. 274. P. A163–A165.
11. Browder F.E. Convergence of approximants in fixed point of non-expansive nonlinear maps in Banach spaces // Arch. Ration. Mech. Anal. 1967. V. 24. № 1. P. 82–90.
12. Halperin B. Fixed point of nonexpansive maps // Bull. Amer. Math. Soc. 1967. V. 73. № 6. P. 57–961.
13. Тихонов А.Н., Гончарский А.В., Степанов В.В., Ягола А.Г. Регуляризирующие алгоритмы и априорная информация. М: Наука, 1983.
14. Eicke B. Konvex-restringierte schlechtgestellte Probleme and ihre Regularisierung durch Iterationverfahren // Dr. diss. Berlin, 1991.
15. Бакушинский А.Б., Гончарский А.В. Итеративные методы решения некорректных задач. М.: Наука, 1989.
16. Moreau J.J. Proximité et dualité dans un espace Hilbertien // Bull. Soc. Math. 1965. V. 93. № 2. P. 273–299.
17. Васин В.В. Регуляризованные модифицированные α -процессы для нелинейных уравнений с монотонным оператором // ДАН. 2016. Т. 469. № 1. С. 13–16.
18. Красносельский М.А., Вайникко Г.М., Забрейко П.П. и др. Приближенное решение операторных уравнений. Москва: Наука, 1969.
19. Tautenhahn U. On the method Lavrentiev regularisation for nonlinear ill-posed problems // Inverse Problems. 2002. V. 18. № 1. P. 191–207.
20. Васин В.В. Итерационные процессы для некорректно поставленных задач с монотонным оператором // Математические труды. 2018. Т. 21. № 2. С. 117–135.
21. Ivanov V.K., Vasin V.V., Tanana V.P. Theory of linear ill-posed problems and its applications. Utrecht/Boston/Köln/Tokyo: VSP, 2002.
22. Гаевский Х., Грёгер К., Захариас К. Нелинейные операторные уравнения и операторные дифференциальные уравнения. М.: Мир, 1978.