OPTIMIZACIÓN - 1er Cuatrimestre 2011

Práctica 4

De acá en más trabajaremos con el problema general de programación no lineal:

$$\begin{cases} \min f(x) \\ h(x) = 0 \\ c(x) \leq 0 \end{cases}$$

Llamaremos también $M = \{y : \nabla h(x) y = 0\}$, que depende de x y de las restricciones.

Ejercicio 1 Probar que si $h(x) = Ax + b$ ($g \equiv 0$), la regularidad no es necesaria para la validez del teorema de los multiplicadores de Lagrange.

Ejercicio 2 Probar que si x^* es minimizador local del problema (con $g \equiv 0$), entonces existen $\lambda_0, \lambda_1, ..., \lambda_m \in \mathbb{R}$, tales que $\lambda_0 \nabla f(x^*) + \sum_{i=1}^{m} \lambda_i \nabla h_i(x^*) = 0$.

Ejercicio 3 Considere el siguiente problema de programación no lineal:

$$\begin{cases} \min 3x_1^2 + x_2^2 + 2x_3^2 - 6x_1 - 10x_2 - 4x_3 + 800 \\ x_1 + x_2 + x_3 = 20 \\ 2x_1 + 4x_3 = 24 \end{cases}$$

1. Usar la estrategia para buscar el mínimo y formular el problema de multiplicadores de Lagrange asociado.
2. Usando el método de Newton, calcular (x^*, λ^*).
3. Verificar que $y^t \nabla^2 \mathcal{L}(x^*, \lambda^*) y > 0, \ \forall y \in M, y \neq 0$.
4. Concluir que x^* aproxima a un minimizador local estricto del problema original.

Ejercicio 4 Realizar el mísmo análisis que en el ejercicio anterior para el siguiente problema:

$$\begin{cases} \min 2e^{3x_1} + 3x_2^2 + 5x_3^4 + 4 \\ \|x\| = 4 \\ \sum_{i=1}^{3} x_i = 3 \end{cases}$$

Para el paso 2, comenzar en el algoritmo de Newton con los siguientes valores iniciales: a) $(1, 2, 3, 4, 5)$ y b) $(-10, 20, -3, 1, 1)$.

Ejercicio 5 Considere el problema perturbado $MRI(\varepsilon)$:

$$\begin{cases} \text{mín } f(x) \\ h(x) = \varepsilon \end{cases}$$

Sea x^* una solución regular de $MRI(0)$. Denotando $x^* = x(0)$ y usándose las condiciones de optimalidad para $MRI(\varepsilon)$ y el teorema de la función implícita para definir $x(\varepsilon)$, pruebe que

$$\frac{\partial f}{\partial \varepsilon_i}(x(0)) = -\lambda_i \qquad i = 1, ...m$$

Ejercicio 6 Considere el problema cuadrático:

$$\begin{cases} \text{mín } \frac{1}{2}x^t Q x - b^t x \\ Ax = c \end{cases}$$

Probar que x^* es mínimo local sí y sólo sí x es un mínimo global.

Ejercicio 7 En R^2 considere las restricciones

$$\begin{cases} x_1 \geq 0 \\ x_2 \geq 0 \\ x_2 - (x_1 - 1)^2 \leq 0 \end{cases}$$

Muestre que el punto $(1, 0)$ es factible pero no es un punto regular.

Ejercicio 8 Buscar el mínimo de $f(x) = x_1^2 + x_2^2$ con $x \in \Omega$.
Donde $\Omega = \{(x_1, x_2) \in \mathbb{R}^2 : x_1 + x_2 = 10 \, \text{y} \, x_1^2 + x_2^2 \leq 225\}$

Ejercicio 9 (Entropía) Considere una función de probabilidad discreta que corresponde a que un valor tome uno de n valores $x_1, ...x_n$ con probabilidad p_i. Los p_i satisfacen $p_i \geq 0$ y $\sum_i p_i = 1$. La entropía de dicha densidad es:

$$\epsilon = -\sum p_i \log(p_i)$$

Si la media de la densidad es conocida ($m = \sum_i x_i p_i$), hallar mediante un planteo de programación no lineal el valor de máxima entropía.

Ejercicio 10 Para entregar Buscar 3 puntos y un radio tal que los círculos formados maximicen la superficie dentro de un cuadrado de lado l. Plantee el problema (funcional a maximizar y reestricciones), poner en el contexto del problema modelo. Plantear el problema asociado usando las condiciones KKT. Finalmente resolver el problema.