

УДК 519.3

ПРОЕКЦИОННЫЙ МЕТОД С РЕГУЛИРУЕМОЙ ТОЧНОСТЬЮ  
ДЛЯ ЗАДАЧИ ВЫПУКЛОГО ПРОГРАММИРОВАНИЯ

В.А.Булавский

При решении некоторых задач, в частности задач математического программирования, имеются случаи, когда естественно возникающий метод решения носит итеративный характер, а каждая итерация, в свою очередь, формулируется в терминах таких операций, которые не могут быть выполнены точно в конечное число действий. Для их выполнения приходится применять итеративные методы. Это требует дополнительных обоснований внешнего метода. Поэтому уже основной итеративный процесс должен предполагать выполнение итераций с определенной точностью. Как правило, эта точность должна возрастать по мере приближения к решению, но слишком быстрое ее возрастание также нежелательно, так как влечет увеличение трудоемкости каждой итерации. В предлагаемой статье на примере задачи математического программирования рассматривается некоторая схема автоматического регулирования точности выполнения итераций. При этом получается метод, в котором как отклонение от допустимого множества, так и значение максимизируемой функции ведут себя немонотонно. Тем не менее для компактного случая удается доказать сходимость.

Предположим, что на выпуклом замкнутом множестве  $Q$  в  $n$ -мерном гильбертовом пространстве  $H$  нужно максимизировать значение линейной непрерывной формы  $l$ . Общий случай максимизации вогнутой функции  $f$  сводится к максимизации числа  $t$  при дополнительном ограничении  $t - f(x) \leq 0$ . Ниже будем исходить из того, что мы умеем с любой степенью точности нахо-

дять проекцию любой точки на множество  $Q$ . Сначала рассмотрим идеальный случай, когда проекция на  $Q$  находится точно.

Выберем последовательность строго положительных чисел  $\{\lambda_n\}$  и точку  $y_0 \in H$ . Построим последовательность  $\{y_n\}$ , определив  $y_{n+1}$  как проекцию на  $Q$  точки  $y_n + \lambda_n l = z_n$ .

**ТЕОРЕМА.** Если форма  $l$  достигает максимума на множестве  $Q$  и ряд  $\sum \lambda_n$  расходится, то последовательность  $\{y_n\}$  слабо сходится к некоторой точке максимума формы  $l$  на  $Q$ .

**ДОКАЗАТЕЛЬСТВО.** Заметим, что доказательства требует лишь случай  $\|l\| \neq 0$ . Для каждой точки  $x \in H$  через  $Px$  обозначим точку множества  $Q$ , ближайшую к  $x$ . В силу выпуклости множества  $Q$  при всех  $x', x'' \in H$  имеет место неравенство  $\|Px' - Px''\| \leq \|x' - x''\|$ . В частности, если  $\bar{x}$  - некоторая точка максимума формы  $l$  на  $Q$  и, следовательно,

$P(\bar{x} + \alpha l) = \bar{x}$  при любом  $\alpha \geq 0$ , то  $\|y_{n+1} - \bar{x}\| = \|P(y_n + \lambda_n l) - P(\bar{x} + \lambda_n l)\| \leq \|y_n - \bar{x}\|$ , т.е. расстояние от  $y_n$  до любой точки максимума формы  $l$  не возрастает с ростом  $n$ . Таким образом, последовательность  $\{y_n\}$  ограничена.

Покажем, что  $z_{n+1} \notin Q$ , если  $z_n \notin Q$ . Действительно, если бы точка  $z_{n+1}$  принадлежала  $Q$ , то точка  $(\lambda_n z_{n+1} + \lambda_{n+1} y_n) / (\lambda_n + \lambda_{n+1}) + \lambda_{n+1} l = [\lambda_n (y_{n+1} + \lambda_{n+1} l) + \lambda_{n+1} (z_n - \lambda_n l)] / (\lambda_n + \lambda_{n+1}) =$

$$= (\lambda_n y_{n+1} + \lambda_{n+1} z_n) / (\lambda_n + \lambda_{n+1}) = \bar{y}$$

также принадлежала бы  $Q$ . Но  $y_{n+1} \neq z_n$ , так как  $y_{n+1} \in Q$ , а  $z_n \notin Q$ . Поэтому  $\|\bar{y} - z_n\| = \lambda_{n+1} \|y_{n+1} - z_n\| / (\lambda_n + \lambda_{n+1}) < \|y_{n+1} - z_n\|$ , что противоречит равенству  $y_{n+1} = Pz_n$ , поскольку точка  $\bar{y} \in Q$  оказалась ближе к  $z_n$ , чем  $y_{n+1}$ . С другой стороны, если бы точки  $z_n$  принадлежали  $Q$  при всех  $n$ , то при всех  $n$  было бы  $y_{n+1} = y_n + \lambda_{n+1} l$  и форма  $l$  была бы неограниченной на  $Q$ . Поэтому, начиная с некоторого  $n$ , все точки  $z_n$  не принадлежат  $Q$ , и  $\|z_n - y_{n+1}\| > 0$ . Можно считать, что это неравенство имеет место при всех  $n$ .

Положим  $z_{n+1} = (z_n - y_{n+1}) / \|z_n - y_{n+1}\|$ . Понятно, что  $(l, z_n) \in \|e\|$ . Так как  $y_n$  и  $y_{n+1}$  принадлежат  $Q$ , а  $y_n$  - ближайшая к  $z_{n-1}$  точка множества  $Q$ , то  $(y_{n+1} - y_n, y_n - z_{n-1}) \geq 0$ , или

$$(z_n - y_n, y_n - z_{n-1}) \geq (z_n - y_{n+1}, y_n - z_{n-1}). \quad (1)$$

Точно так же  $y_{n+1}$  - ближайшая к  $z_n$  точка  $Q$ , и поэтому  $(y_n - y_{n+1}, y_{n+1} - z_n) \geq 0$ , или

$$(z_n - y_n, z_n - y_{n+1}) \geq \|z_n - y_{n+1}\|^2. \quad (2)$$

Разделим (1) на  $\|z_{n-1} - y_n\|$ , (2) - на  $\|z_n - y_{n+1}\|$ , сложим и учтем, что  $z_n - y_n = \lambda_n e$ . Тогда получим

$$\lambda_n [(l, z_{n+1}) - (l, z_n)] \geq \|z_n - y_{n+1}\| (z_n - y_{n+1}, z_n) \geq 0.$$

Таким образом, последовательность  $\{(l, z_n)\}$  неубывающая и ограниченная.

Пусть  $\alpha = \lim (l, z_n)$ . Так как  $\|z_n - y_{n+1}\| \leq \|z_n - y_n\| = \lambda_n \|e\|$ , то

$$\begin{aligned} \Delta_n &= (l, y_{n+1}) - (l, y_n) = (l, y_{n+1}) - (l, z_n - \lambda_n e) = \lambda_n \|e\|^2 (l, z_n - y_{n+1}) = \\ &= \lambda_n \|e\|^2 (l, z_{n+1}) \|z_n - y_{n+1}\| \geq \lambda_n \|e\|^2 \alpha \|z_n - y_{n+1}\| \geq \lambda_n \|e\| (\|e\| - \alpha). \end{aligned}$$

Поскольку ряд  $\sum \Delta_n$  ввиду ограниченности формы  $l$  на  $Q$  сходится, а ряд  $\sum \lambda_n$  расходится, то  $\alpha = \|e\|$ . Если при некотором  $n$  окажется  $(l, z_n) = \|e\|$ , т.е.  $z_n = e / \|e\|$ , то это означает, что  $(l, x - y_n) \leq 0$  при  $x \in Q$ , т.е. что  $y_n$  - точка максимума формы  $l$ . При этом  $y_{n+k} = y_n$  при  $k=1, 2, \dots$ .

Пусть  $(l, z_n) < \|e\|$  при всех  $n$ . Так как

$$\|z_n - \frac{e}{\|e\|}\|^2 = \frac{2}{\|e\|} (\|e\| - (l, z_n)),$$

то последовательность  $\{z_n\}$  сильно сходится к  $\frac{e}{\|e\|}$ . Ввиду ограниченности последовательности  $\{y_n\}$  существует подпоследовательность  $\{y_{n_j}\}$ , слабо сходящаяся к некоторой точке  $\bar{y}$  на  $Q$  (так как  $Q$  выпукло и замкнуто). Поскольку  $(l, z_{n_j}, x - y_{n_j}) \leq 0$  при любом  $x \in Q$ , то в силу ограниченности  $y_{n_j}$  в пределе получим, что  $(l, x - \bar{y}) \leq 0$  при  $x \in Q$ . Таким образом, точка  $\bar{y}$  максимизирует форму  $l$  на множестве  $Q$ . По-

этому  $\|y_{n+1} - \bar{y}\| \leq \|y_n - \bar{y}\|$  при всех  $n$ . Если  $\bar{y}$  - другая слабо предельная точка последовательности  $\{y_n\}$ , то она тоже является точкой максимума формы  $\ell$  на  $Q$  и  $\|y_{n+1} - \bar{y}\| \leq \|y_n - \bar{y}\|$  при всех  $n$ . Поэтому существует  $\lim(y_n, \bar{y} - \bar{y})$ , так что  $(\bar{y}, \bar{y} - \bar{y}) = (\bar{y}, \bar{y} - \bar{y})$ , т.е.  $\bar{y} = \bar{y}$ . Из ограниченности последовательности  $\{y_n\}$  и единственности слабо предельной точки следует слабая сходимость этой последовательности. Теорема доказана.

При практических вычислениях проекция на множество  $Q$  конечно определяется с некоторой погрешностью. Естественно построить процесс так, чтобы эта погрешность уменьшалась по мере приближения к решению. Чтобы иметь возможность оценивать погрешность, с которой найдена проекция, предположим, что выбрана неотрицательная функция  $\varphi$  на  $H$ , обладающая следующим свойством:  $d(\varepsilon) = \sup\{\inf\{\|x - y\| : y \in Q\} : \varphi(x) \leq \varepsilon\} < +\infty$  при  $\varepsilon > 0$  и  $\lim_{\varepsilon \rightarrow +0} d(\varepsilon) = 0$ . Если множество  $Q$  задано системой уравнений и неравенств, то в качестве  $\varphi$  часто может выступать некоторая функция невязок при подстановке  $x$  в систему, например максимальная невязка или (взвешенная) сумма невязок. Опишем и обобщим некоторую вычислительную процедуру, каждый шаг которой требует конечного числа действий. При этом необходимая точность проекции определяется в значительной степени автоматически. Как и раньше, через  $P_Q$  будем обозначать точную проекцию точки  $\varphi$  на множество  $Q$ .

Выберем две убывающие и стремящиеся к нулю последовательности положительных чисел  $\{\varepsilon_k : k=0, 1, \dots\}$  и  $\{\delta_k : k=0, 1, \dots\}$ , а также точку  $y_0 \in H$ , для которой  $\varphi(y_0) \leq \varepsilon_0$ . Выполнения последнего условия можно добиться либо выбором соответствующего  $\varepsilon_0$ , либо предварительным поиском с нужной точностью решения системы, описывающей множество  $Q$ . Будем последовательно строить приближения  $y_1, y_2, \dots$ , соотнося каждому  $y_n$  номер  $k_n$ , характеризующий точность попадания  $y_n$  в множество  $Q$ . Именно, всегда будет выполняться условие  $\varphi(y_n) \leq \varepsilon_{k_n}$ . При этом, однако, не обязательно  $\varphi(y_n) > \varepsilon_{k_n+1}$ . Так что мы положим  $k_0 = 0$ , хотя  $y_0$  может даже принадлежать  $Q$ .

Пусть уже построены  $y_0, y_1, \dots, y_n$ . Определим числа  $r_k^{(n)}$ ,  $k=0, 1, \dots$ , равенством  $r_k^{(n)} = \max\{\ell(y_k) : k_2 \geq k\}$ . При переходе от  $n$  к  $n+1$  числа  $r_k^{(n+1)}$  можно вычислить по  $r_k^{(n)}$ , а именно:  $r_k^{(n+1)} = r_k^{(n)}$ , если  $k_{n+1} < k$ , и  $r_k^{(n+1)} = \max\{r_k^{(n)}, \ell(y_{n+1})\}$ .

если  $k_{n+1} \geq k$ . Заметим, что при каждом  $n$  нужно иметь лишь конечное число  $r_k^{(n)}$ , так как  $r_k^{(n)} = -\infty$  при  $k > \max\{k_1, 0, \dots, n\}$ .

Опишем очередной шаг. Будем искать проекцию на множество  $Q$  точки  $y_n + \lambda_n \ell$ . При этом будем применять один из методов, данных вместе с приближением к проекции такое полупространство, что оно содержит множество  $Q$ , а найденное приближение является проекцией  $y_n + \lambda_n \ell$  на это полупространство [1-4]. Мы получим последовательность  $\{x_n^{(j)} : j = 0, 1, \dots\}$ , которая сходится к  $P(y_n + \lambda_n \ell)$ , причем  $(y_n + \lambda_n \ell - x_n^{(j)}, x - x_n^{(j)}) \leq 0$  при  $x \in Q$ . Для каждого  $j$  обозначим через  $x_j$  наименьший номер, для которого  $\varphi(x_n^{(j)}) \geq \varepsilon_{x_j}$  (если окажется, что  $\varphi(x_n^{(j)}) = 0$ , то будем считать  $x_j = +\infty$ ). В итерационном процессе поиска проекции  $P(y_n + \lambda_n \ell)$  остановимся на первом  $\bar{j}$ , для которого  $\varphi(x_n^{(\bar{j})}) \leq \varepsilon_0$  и выполнено одно из следующих (ключевых друг друга) условий:

- а)  $x_{\bar{j}} \leq k_n$ , причем  $(\ell, x_n^{(\bar{j})}) \geq r_{x_{\bar{j}}}^{(n)} + \delta_{x_{\bar{j}}} \cdot \lambda_n$ ;
- б)  $x_{\bar{j}} > k_n$  и  $(\ell, x_n^{(\bar{j})}) \geq r_{k_n}^{(n)} + \delta_{k_n} \cdot \lambda_n$ ;
- в)  $x_{\bar{j}} > k_n$ , но  $(\ell, x_n^{(\bar{j})}) < r_{k_n}^{(n)} + \delta_{k_n} \cdot \lambda_n$ .

Поскольку последовательность  $\{x_n^{(j)} : j = 0, 1, \dots\}$  сходится к  $P(y_n + \lambda_n \ell)$ , а  $\varepsilon_{k_n} > 0$ , то такой номер  $\bar{j}$  найдется и мы примем  $y_{n+1} = x_n^{(\bar{j})}$ . Если реализовался случай а), то положим  $k_{n+1} = x_{\bar{j}}$ , если реализовался случай б), то положим  $k_{n+1} = k_n$ , а если реализовался случай в), то  $k_{n+1} = k_n + 1$ . Заметим, что в качестве  $x_n^{(j)}$  можно (и, как правило, целесообразно) взять проекцию точки  $y_n + \lambda_n \ell$  на полупространство  $\{x \in H : (y_{n-1} + \lambda_{n-1} \ell - y_n, x - y_n) \leq 0\}$ , так как оно содержит  $Q$ . Доказываемая ниже теорема служит обоснованием описанного метода.

**ТЕОРЕМА 2.** Пусть множество  $Q$  компактно и  $0 < \alpha \leq \lambda_n \leq \beta < +\infty$ . Тогда  $\lim [ \min_{y \in Q_0} \{ \|y_n - y_{n-1}\| \} ] = 0$ , где  $Q_0$  - множество точек максимума формы  $\ell$  на  $Q$ .

**ДОКАЗАТЕЛЬСТВО.** Прежде всего заметим, что  $\|y_n - P y_n\| \leq \alpha \varphi(y_n) \leq \alpha(\varepsilon_0)$ . Поэтому  $(\ell, y_n) = (\ell, P y_n) + (\ell, y_n - P y_n) \leq \ell_{\max} + \|\ell\| \cdot \alpha(\varepsilon_0)$ . Здесь  $\ell_{\max} = \max\{(\ell, x) : x \in Q\}$ .

Покажем, что в последовательности  $\{k_n\}$  каждый номер встречается лишь конечное число раз и, следовательно,  $\lim_{n \rightarrow \infty} \psi(y_n) = 0$ . Действительно, предположим, что номера  $0, 1, \dots, s-1$  встречаются конечное число раз. Тогда найдется такое  $N$ , что  $k_n \geq s$  при  $n \geq N$ . Это значит, что если  $n \geq N$  и  $k_{n+1} = s$ , то  $k_n \geq s$  и, следовательно,  $(l, y_{n+1}) \geq r_s^{(n)} + \delta_s \cdot \lambda_n$ . При этом  $r_s^{(n+1)} = (l, y_{n+1}) \geq r_s^{(n)} + \delta_s \alpha$ . Так как  $\delta_s > 0$ , а числа  $r_s^{(n)}$  не убывают при возрастании  $n$ , то ввиду ограниченности  $(l, y_n)$  такая ситуация может повториться лишь конечное число раз, т.е.  $s$  также лишь конечное число раз встречается в последовательности  $\{k_n\}$ .

Положим теперь при  $x \in Q$  и  $\lambda \geq 0$

$$\Delta(x, \lambda) = (l, P(x + \lambda l)) - x.$$

Функция  $\Delta$  непрерывна по паре  $(x, \lambda)$  и  $\Delta(x, 0) = 0$ . Пусть  $\lambda_1, \lambda_2 \geq 0$ . Так как  $P(x + \lambda_1 l) \in Q$  и  $P(x + \lambda_2 l) \in Q$ , то, по определению  $P$ ,

$$(x + \lambda_1 l - P(x + \lambda_1 l), P(x + \lambda_2 l) - P(x + \lambda_1 l)) \leq 0,$$

$$(x + \lambda_2 l - P(x + \lambda_2 l), P(x + \lambda_1 l) - P(x + \lambda_2 l)) \leq 0.$$

Сложив эти неравенства, получим

$$((\lambda_1 - \lambda_2)l + P(x + \lambda_2 l) - P(x + \lambda_1 l), P(x + \lambda_2 l) - P(x + \lambda_1 l)) \leq 0,$$

$$(\lambda_1 - \lambda_2)[\Delta(x, \lambda_1) - \Delta(x, \lambda_2)] \geq \|P(x + \lambda_2 l) - P(x + \lambda_1 l)\|^2.$$

Таким образом,  $\Delta$  - неубывающая по  $\lambda$  функция. Заметим, что если  $\Delta(\bar{x}, \alpha) = 0$  при  $\alpha > 0$ , то  $P\bar{x} = \bar{x}$  и точка  $\bar{x}$  является точкой максимума формы  $l$  на  $Q$ .

Покажем теперь, что для всякого  $\delta > 0$  найдется такой номер  $N_\delta$ , что  $(l, y_{n+1}) - (l, y_n) \geq \frac{\delta}{2}$  для тех  $n \geq N_\delta$ , для которых  $\Delta(Py_n, \alpha) \geq \delta$ . Выберем  $\epsilon > 0$  из условия

$$3\epsilon + \sqrt{\epsilon^2 + \beta \cdot \|l\| \cdot \epsilon} \leq \frac{\delta}{\|l\|},$$

а номер  $N_\delta$  так, что  $\|Py_n - y_n\| \leq \epsilon$  при  $n > N_\delta$ . Положим для краткости  $\bar{x} = P(\lambda_n l + Py_n)$ . Так как  $\bar{x} \in Q$  и  $Py_{n+1} \in Q$ , то, по определению оператора  $P$  и способу получе-

или  $y_{n+1}$ ,

$$(y_n + \lambda_n l - y_{n+1}, z - y_{n+1}) \leq 0,$$

$$(P y_n + \lambda_n l - z, P y_{n+1} - z) \leq 0.$$

Из этих неравенств найдем

$$\begin{aligned} \|z - y_{n+1}\|^2 &\leq (y_n + \lambda_n l - z, y_{n+1} - z) = (y_n - P y_n, y_{n+1} - z) + \\ &+ (P y_n + \lambda_n l - z, y_{n+1} - P y_{n+1}) + (P y_n + \lambda_n l - z, P y_{n+1} - z) \leq \\ &\leq \|y_n - P y_n\| \cdot \|y_{n+1} - z\| + \|P y_n + \lambda_n l - z\| \cdot \|y_{n+1} - P y_{n+1}\|. \end{aligned}$$

Но  $P y_n$  тоже принадлежит  $Q$ . Поэтому  $(P y_n + \lambda_n l - z, P y_n - z) \leq 0$  и, следовательно,  $\|P y_n + \lambda_n l - z\| \leq \lambda_n \|l\| \leq \beta \|l\|$ . Таким образом,  $\|z - y_{n+1}\|^2 \leq \epsilon \|z - y_{n+1}\| + \epsilon \beta \cdot \|l\|^2$ , откуда получаем

$$\|P(\lambda_n l + P y_n) - y_{n+1}\| = \|z - y_{n+1}\| \leq \frac{1}{2}(\epsilon + \sqrt{\epsilon^2 + 4\beta \cdot \|l\|^2 \cdot \epsilon}).$$

Оценим выражение формы  $l$ .

$$\begin{aligned} (l, y_{n+1}) - (l, y_n) &= (l, P(\lambda_n l + P y_n)) - (l, P y_n) + (l, P y_n - y_n) + \\ &+ (l, y_{n+1} - P(\lambda_n l + P y_n)) \geq \Delta(P y_n, \lambda_n) - \|l\| \cdot \|P y_n - y_n\| - \\ &- \|l\| \cdot \|y_{n+1} - z\| \geq \delta - \|l\| \left( \epsilon + \frac{\epsilon + \sqrt{\epsilon^2 + 4\beta \cdot \|l\|^2 \cdot \epsilon}}{2} \right) \geq \frac{\delta}{2}. \end{aligned}$$

Таким образом, существует нужное  $N_\delta$ . Для определенности можно считать, что  $N_\delta$  - наименьший из пригодных номеров.

Положим для  $\eta > 0$

$$r(\eta) = \inf \{ \Delta(x, \alpha) : x \in Q, (l, x) \leq l_{\max} - \eta \}$$

и покажем, что  $r(\eta) > 0$ . Действительно, пусть существует такая последовательность  $\{x_\tau, \tau = 1, 2, \dots\}$ , что  $(l, x_\tau) \leq l_{\max} - \eta$  и  $\lim \Delta(x_\tau, \alpha) = 0$ . В силу непрерывности  $\Delta$  для предельной точки  $\bar{x}$  получим  $(l, \bar{x}) \leq l_{\max} - \eta$  и  $\Delta(\bar{x}, \alpha) = 0$ , что невозможно, так как при  $\Delta(\bar{x}, \alpha) = 0$  должно быть  $(l, \bar{x}) = l_{\max}$ .

Покажем теперь, что  $\lim (l, y_n) = l_{\max}$ . Заметим прежде всего, что при всех  $n$

$$(y_n + \lambda_n l - y_{n+1}, P y_n - y_{n+1}) \leq 0,$$

и поэтому

$$\begin{aligned} \lambda_n (l, P y_n - y_{n+1}) &\leq -\|P y_n - y_{n+1}\|^2 + (P y_n - y_{n+1}, P y_n - y_{n+1}) \leq \\ &\leq -\|P y_n - y_{n+1}\|^2 + \|P y_n - y_n\| \cdot \|P y_n - y_{n+1}\| \leq \frac{\|P y_n - y_n\|^2}{4}. \end{aligned}$$

Таким образом,

$$(l, P y_n) \leq (l, y_{n+1}) + \frac{\|P y_n - y_n\|^2}{4\alpha}. \quad (3)$$

Возьмем  $\varrho > 0$  и выберем  $N$  настолько большим, что  $N > N_{\gamma}(\frac{\varrho}{2})$  и  $\|P y_n - y_n\| \leq \sqrt{2\varrho\alpha}$  при  $n \geq N$  (напомним, что в начале доказательства было получено равенство  $\lim \varphi(y_n) = 0$  и, следовательно,  $\lim \|P y_n - y_n\| = 0$ ). Предположим, что при некотором  $n > N$  оказалось  $(l, y_n) \leq l_{\max} - \varrho$ . Тогда согласно (3)

$$(l, P y_{n-1}) \leq (l, y_n) + \frac{\|P y_{n-1} - y_{n-1}\|^2}{4\alpha} \leq l_{\max} - \frac{\varrho}{2}.$$

Поэтому  $\Delta(P y_{n-1}, \alpha) \geq \gamma(\frac{\varrho}{2})$ , и так как  $n-1 \geq N_{\gamma}(\frac{\varrho}{2})$ , то

$$(l, y_{n-1}) \leq (l, y_n) - \frac{1}{2} \gamma(\frac{\varrho}{2}) < l_{\max} - \varrho.$$

Таким образом, если для некоторого  $m > 0$  оказалось  $(l, y_{N+m}) \leq l_{\max} - \varrho$ , то

$$(l, y_N) \leq (l, y_{N+m}) - \frac{m}{2} \gamma(\frac{\varrho}{2}) \leq l_{\max} - \varrho - \frac{m}{2} \gamma(\frac{\varrho}{2}).$$

Так что

$$m \leq \frac{2[l_{\max} - \varrho - (l, y_N)]}{\gamma(\frac{\varrho}{2})} = M.$$



Мы установили, что  $(\ell, y_n) > \ell_{\max} - \varrho$  при  $n > N + M$ . Поскольку  $\varrho$  было произвольным, то  $\lim (\ell, y_n) = \ell_{\max}$

Так как  $\lim \|Py_n - y_n\| = 0$ , то  $\lim (\ell, Py_n) = \ell_{\max}$  и ввиду компактности множества  $Q$  получаем, что

$$\lim [\min \{ \|Py_n - y\| : y \in Q \}] = 0,$$

откуда и следует утверждение теоремы.

**ЗАМЕЧАНИЕ.** Судить о достигнутой точности для приближения  $y_n$  можно по значению  $\varphi(y_n)$ , что характеризует точность попадания в  $Q$ , и по величине

$$\frac{(\ell, y_{n-1} + \lambda_{n-1} \ell - y_n)}{\| \lambda_{n-1} y_{n-1} + \lambda_{n-1} \ell - y_n \|}$$

Отклонение от единицы этой величины при малом  $\varphi(y_n)$  характеризует отклонение  $\ell$  от конуса нормалей к множеству  $Q$  в точке  $Py_n$ , т.е. точность выполнения признака максимума.

### Л и т е р а т у р а

1. БУЛАВСКИЙ В.А. Один специальный алгоритм квадратичного программирования. - В кн.: Оптимизация. Вып. 5, Новосибирск, 1972, с. 23-26.
2. БУЛАВСКИЙ В.А. Об одном типе проекционных методов в математическом программировании. - В кн.: Оптимизация. Вып. 5, Новосибирск, 1972, с. 11-22.
3. БУЛАВСКИЙ В.А. О конечномерной аппроксимации в некоторых выпуклых задачах. - В кн.: Оптимизация. Вып. 9, Новосибирск, 1973, с. 181-187.
4. ЛОБЫРЕВ А.И. О минимизации строго выпуклой функции на пересечении выпуклых множеств. - В кн.: Оптимизация. Вып. 5, Новосибирск, 1972, с. 128-132.

Поступила в ред.-мод. отд.  
28. VI. 1974 г.