
УДК 517.5

В. Ф. Бабенко

(Днепропетр. нац. ун-т; Ин-т прикл. математики и механики НАН Украины, Донецк),

В. В. Бабенко (Днепропетр. нац. ун-т)

ОПТИМИЗАЦИЯ ПРИБЛИЖЕННОГО ИНТЕГРИРОВАНИЯ МНОГОЗНАЧНЫХ ФУНКЦИЙ, МОНОТОННЫХ ПО ВКЛЮЧЕНИЮ

The best quadrature formula is found for the class of convex-valued functions defined on the interval $[0, 1]$ and monotone with respect to an inclusion.

Знайдено найкращу квадратурну формулу на класі заданих на відрізок $[0, 1]$ опуклозначних функцій, монотонних відносно включення.

Введение. Теория многозначных отображений активно развивается в течение последних десятилетий в связи с потребностями теории оптимизации, теории игр, математической экономики и других областей математики. Обзор достижений в этом направлении и дальнейшие ссылки можно найти в [1 – 3]. В последнее время интерес математиков вызывают задачи аппроксимации многозначных отображений (см., например, [4 – 8]). Важным направлением теории аппроксимации и численного анализа является теория квадратурных формул (см., например, [9]). Вместе с тем авторам неизвестны работы, касающиеся оптимизации приближенного интегрирования многозначных функций. Данная работа посвящена именно этой проблематике.

Существует много различных подходов к определению интегралов от многозначных функций (см. [10]). Одним из наиболее элементарных является подход Хукухары [11], который предложил рассматривать обобщение интеграла Римана для функций со значениями в пространстве $\mathcal{K}(\mathbb{R}^d)$ компактных выпуклых подмножеств пространства \mathbb{R}^d (ниже для полноты изложения будут приведены определение и элементарные свойства этого интеграла).

Мы будем рассматривать задачу оптимизации приближенного вычисления интегралов в смысле Хукухары на классе монотонных по включению функций $f : [0, 1] \rightarrow \mathcal{K}(\mathbb{R}^d)$, которые на концах отрезка $[0, 1]$ принимают заданные значения: $f(0) = A$, $f(1) = B$. Полученные для этого класса результаты обобщают известные для числовых функций результаты Кифера [12].

Кратко опишем структуру статьи.

В первом пункте приведены необходимые определения и факты, касающиеся пространства компактных выпуклых множеств, во втором — необходимые определения и факты, касающиеся интегрирования многозначных (выпуклозначных) функций. В третьем пункте решается задача о наилучшей квадратурной

формуле на классе монотонных (относительно включения) функций $f : [0, 1] \rightarrow \mathcal{K}(\mathbb{R}^d)$.

1. Пространство выпуклых множеств в \mathbb{R}^d . Через $\mathcal{K} = \mathcal{K}(\mathbb{R}^d)$ будем обозначать совокупность непустых компактных выпуклых подмножеств пространства \mathbb{R}^d . В совокупности \mathcal{K} вводятся следующие операции.

Пусть $A, B \in \mathcal{K}$, $\alpha \geq 0$. Тогда

$$A + B =: \{x + y : x \in A, y \in B\}, \quad \alpha A =: \{\alpha x : x \in A\}.$$

Множество $A + B$ называется суммой Минковского множеств A и B .

В исследованиях по аппроксимации выпуклых тел многогранниками используются различные метрики в $\mathcal{K} = \mathcal{K}(\mathbb{R}^d)$ (см., например, [13]). Мы будем использовать метрику Хаусдорфа $\delta^H(A, B)$, которая определяется следующим образом:

$$\delta^H(A, B) = \max \left\{ \sup_{x \in A} \inf_{y \in B} |x - y|, \sup_{x \in B} \inf_{y \in A} |x - y| \right\},$$

где $|\cdot|$ — евклидова норма в \mathbb{R}^d .

Опорной функцией выпуклого множества $A \in \mathcal{K}$ называется определенная на единичной сфере S^{d-1} пространства \mathbb{R}^d функция

$$h_A(u) = \sup_{x \in A} \langle x, u \rangle, \quad u \in S^{d-1}.$$

В терминах опорной функции метрику δ^H можно представить в виде

$$\delta^H(C, D) = \sup_{u \in S^{d-1}} |h_C(u) - h_D(u)|. \quad (1)$$

Отметим, что по отношению к метрике δ^H сумма Минковского и операция умножения на неотрицательные числа непрерывны, а метрическое пространство $\langle \mathcal{K}, \delta^H \rangle$ является полным.

Для нас важными будут два следующих свойства метрики δ^H :

1) для любых $A, B, C, D \in \mathcal{K}$

$$\delta^H(A + B, C + D) \leq \delta^H(A, C) + \delta^H(B, D); \quad (2)$$

2) для любых $A, B \in \mathcal{K}$ и любого $\alpha \geq 0$

$$\delta^H(\alpha A, \alpha B) = \alpha \delta^H(A, B). \quad (3)$$

Свойство (3) является очевидным. Проверим выполнение свойства (2). Для произвольных выпуклых множеств A, B, C, D , используя представление (1), получаем

$$\begin{aligned} \delta^H(A + B, C + D) &= \\ &= \max \left\{ \sup_{u \in S^{d-1}} (h_{A+B}(u) - h_{C+D}(u)), \sup_{u \in S^{d-1}} (h_{C+D}(u) - h_{A+B}(u)) \right\} = \end{aligned}$$

$$= \max \left\{ \sup_{u \in S^{d-1}} (h_A(u) - h_C(u) + h_B(u) - h_D(u)), \right. \\ \left. \sup_{u \in S^{d-1}} (h_C(u) - h_A(u) + h_D(u) - h_B(u)) \right\}.$$

Учитывая, что

$$\sup_{u \in S^{d-1}} (h_A(u) - h_C(u) + h_B(u) - h_D(u)) \leq \\ \leq \sup_{u \in S^{d-1}} (h_A(u) - h_C(u)) + \sup_{u \in S^{d-1}} (h_B(u) - h_D(u))$$

и

$$\sup_{u \in S^{d-1}} (h_C(u) - h_A(u) + h_D(u) - h_B(u)) \leq \\ \leq \sup_{u \in S^{d-1}} (h_C(u) - h_A(u)) + \sup_{u \in S^{d-1}} (h_D(u) - h_B(u)),$$

находим

$$\delta^H(A + B, C + D) \leq \\ \leq \max \left\{ \sup_{u \in S^{d-1}} (h_A(u) - h_C(u)) + \sup_{u \in S^{d-1}} (h_B(u) - h_D(u)), \right. \\ \left. \sup_{u \in S^{d-1}} (h_C(u) - h_A(u)) + \sup_{u \in S^{d-1}} (h_D(u) - h_B(u)) \right\} \leq \\ \leq \max \left\{ \sup_{u \in S^{d-1}} (h_A(u) - h_C(u)), \sup_{u \in S^{d-1}} (h_C(u) - h_A(u)) \right\} + \\ + \max \left\{ \sup_{u \in S^{d-1}} (h_B(u) - h_D(u)), \sup_{u \in S^{d-1}} (h_D(u) - h_B(u)) \right\} = \\ = \delta^H(A, C) + \delta^H(B, D).$$

В заключение пункта отметим следующее. Если мы сумму Минковского распространим на произвольное конечное число множеств A_k , $k = 1, \dots, n$, положив

$$\sum_{k=1}^n A_k := \sum_{k=1}^{n-1} A_k + A_n,$$

то по индукции из свойства (2) метрики δ^H получим

$$\delta^H \left(\sum_{k=1}^n A_k, \sum_{k=1}^n B_k \right) \leq \sum_{k=1}^n \delta^H(A_k, B_k). \quad (4)$$

2. Интегрирование многозначных функций. Напомним, что разбиением P отрезка $[a, b]$, $a < b$, называется конечная система точек x_0, \dots, x_n этого отрезка, такая, что $a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b$. Параметром разбиения P называется число

$$\lambda(P) := \max_{i=1, n} |x_i - x_{i-1}|.$$

Если в каждом из отрезков $[x_{i-1}, x_i]$ разбиения P выбрано по точке $\xi_i \in [x_{i-1}, x_i]$, $i = 1, \dots, n$, то получаем разбиение (P, ξ) отрезка $[a, b]$ с отмеченными точками $(\xi = (\xi_1, \dots, \xi_n))$.

Пусть задана функция $f : [a, b] \rightarrow \mathcal{K}$. Каждому разбиению (P, ξ) с отмеченными точками поставим в соответствие интегральную сумму

$$\sigma(f; (P, \xi)) = \sum_{i=1}^n f(\xi_i) \Delta x_i,$$

где $\Delta x_i = x_i - x_{i-1}$.

Определение. Если существует элемент $I \in \mathcal{K}$ такой, что для любого $\varepsilon > 0$ найдется $\delta > 0$ такое, что для любого разбиения (P, ξ) с отмеченными точками, параметр которого $\lambda(P) < \delta$, имеет место соотношение

$$\delta^H \left(I, \sum_{i=1}^n f(\xi_i) \Delta x_i \right) < \varepsilon,$$

то говорят, что функция $f : [a, b] \rightarrow \mathcal{K}$ интегрируема на отрезке $[a, b]$, а элемент I называется ее интегралом. При этом пишут

$$I = \int_a^b f(x) dx.$$

Совокупность всех интегрируемых функций $f : [a, b] \rightarrow \mathcal{K}$ будем обозначать через $\mathcal{R}([a, b], \mathcal{K})$.

Аналогично случаю числовых функций устанавливаются следующие утверждения.

Утверждение 1. Любая непрерывная на $[a, b]$ функция $f : [a, b] \rightarrow \mathcal{K}$ является интегрируемой на $[a, b]$.

Утверждение 2. Любая функция $f : [a, b] \rightarrow \mathcal{K}$, монотонная в том смысле, что

$$a \leq x_1 < x_2 \leq b \Rightarrow f(x_1) \subset f(x_2), \quad (5)$$

является интегрируемой на $[a, b]$.

Утверждение 3. Если f, g принадлежат $\mathcal{R}([a, b], \mathcal{K})$, то их линейная комбинация $\alpha f + \beta g$ с неотрицательными коэффициентами также интегрируема на $[a, b]$, причем

$$\int_a^b (\alpha f + \beta g)(x) dx = \alpha \int_a^b f(x) dx + \beta \int_a^b g(x) dx.$$

Утверждение 4. Если $a < b < c$ и $f \in \mathcal{R}([a, c], \mathcal{K})$, то $f|_{[a, b]} \in \mathcal{R}([a, b], \mathcal{K})$, $f|_{[b, c]} \in \mathcal{R}([b, c], \mathcal{K})$ и имеет место равенство

$$\int_a^c f(x) dx = \int_a^b f(x) dx + \int_b^c f(x) dx.$$

Утверждение 5. Если функция f монотонна на $[a, b]$ в смысле (5), то справедливы включения

$$f(a)(b-a) \subset \int_a^b f(x) dx \subset f(b)(b-a).$$

Используя определение интеграла и свойство (4) метрики Хаусдорфа, нетрудно установить следующее утверждение.

Утверждение 6. Если f, g принадлежат $\mathcal{R}([a, b], \mathcal{K})$, то

$$\delta^H \left(\int_a^b f(x) dx, \int_a^b g(x) dx \right) \leq \int_a^b \delta^H(f(x), g(x)) dx.$$

3. Оптимизация квадратурных формул на классах монотонных многозначных функций. Пусть $M_{A,B}$ ($A \subset B$) — класс функций $f: [0; 1] \rightarrow \mathcal{K}(\mathbb{R}^d)$, монотонных в смысле (5) и таких, что $f(0) = A$, $f(1) = B$, где A, B — заданные множества.

Рассмотрим задачу о наилучшей на классе $M_{A,B}$ квадратурной формуле вида

$$q(f) = C + \sum_{k=1}^{n-1} c_k f(x_k), \quad (6)$$

где $C \in \mathcal{K}(\mathbb{R}^d)$, $c_1, \dots, c_{n-1} \geq 0$, $0 \leq x_1 < \dots < x_{n-1} \leq 1$. Совокупность всех таких формул обозначим через Q . Задача формулируется следующим образом.

Положим

$$R_{n-1}(M_{A,B}) = \inf_{q \in Q} \sup_{f \in M_{A,B}} \delta^H \left(\int_0^1 f(x) dx, q(f) \right). \quad (7)$$

Требуется найти величину (7) и квадратурную формулу вида (6), реализующую точную нижнюю грань в правой части (7). Именно такая формула называется наилучшей на классе $M_{A,B}$.

Справедлива следующая теорема.

Теорема. Среди всех квадратурных формул вида (6) наилучшей на классе $M_{A,B}$ является формула

$$q_{n-1}(f) = \frac{A+B}{2n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right),$$

при этом

$$R_{n-1}(M_{A,B}) = \sup_{f \in M_{A,B}} \delta^H \left(\int_0^1 f(x) dx, q_{n-1}(f) \right) = \frac{1}{2n} \delta^H(A, B).$$

Доказательство. Учитывая аддитивность интеграла (утверждение 4), монотонность функции f и монотонность интеграла (утверждение 5), имеем

$$\int_0^1 f(x) dx = \sum_{k=0}^{n-1} \int_{k/n}^{(k+1)/n} f(x) dx \subset \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right) + \frac{B}{n}.$$

Аналогично

$$\frac{A}{n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right) \subset \sum_{k=0}^{n-1} \int_{k/n}^{(k+1)/n} f(x) dx = \int_0^1 f(x) dx.$$

Таким образом,

$$\frac{A}{n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right) \subset \int_0^1 f(x) dx \subset \frac{B}{n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right). \quad (8)$$

Имеют место следующие включения:

$$\frac{A}{n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right) \subset \frac{A+B}{2n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right) \subset \frac{B}{n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right). \quad (9)$$

Оценим

$$\delta^H \left(\int_0^1 f(x) dx, \frac{A+B}{2n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right) \right).$$

Докажем, что если

$$X \subset Y \subset Z, \quad (10)$$

то

$$\delta^H \left(Y, \frac{X+Z}{2} \right) \leq \frac{1}{2} \delta^H(X, Z). \quad (11)$$

Отсюда с учетом (8) и (9) получим

$$\delta^H \left(\int_0^1 f(x) dx, \frac{A+B}{2n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} f\left(\frac{k}{n}\right) \right) \leq \frac{1}{2n} \delta^H(A, B). \quad (12)$$

Итак, докажем (11).

Для $X, Y \in \mathcal{K}$ будем использовать обозначение

$$e(X, Y) = \sup_{x \in X} \inf_{y \in Y} |x - y|.$$

Рассмотрим

$$\delta^H \left(Y, \frac{X+Z}{2} \right) = \max \left(e \left(Y, \frac{X+Z}{2} \right), e \left(\frac{X+Z}{2}, Y \right) \right).$$

В силу (10) и свойства (2) метрики Хаусдорфа имеем

$$e \left(Y, \frac{X+Z}{2} \right) \leq e \left(Z, \frac{X+Z}{2} \right) \leq \delta^H \left(Z, \frac{X+Z}{2} \right) \leq \frac{1}{2} \delta^H(X, Z).$$

Далее

$$e \left(\frac{X+Z}{2}, Y \right) \leq e \left(\frac{X+Z}{2}, X \right) \leq \delta^H \left(\frac{X+Z}{2}, X \right) \leq \frac{1}{2} \delta^H(X, Z).$$

Таким образом,

$$\delta^H \left(Y, \frac{X+Z}{2} \right) = \max \left(e \left(Y, \frac{X+Z}{2} \right), e \left(\frac{X+Z}{2}, Y \right) \right) \leq \frac{1}{2} \delta^H(X, Z).$$

Соотношение (11), а с ним и соотношение (12) доказаны.

Теперь покажем, что для любой квадратурной формулы вида (6)

$$\sup_{f \in M_{A,B}} \delta^H \left(\int_0^1 f(x) dx, q(f) \right) \geq \frac{1}{2n} \delta^H(A, B).$$

Отсюда и будет следовать утверждение теоремы.

Для произвольного набора точек $0 = x_0 \leq x_1 < \dots < x_{n-1} \leq x_n = 1$ найдется $k = 0, 1, \dots, n-1$ такое, что $x_{k+1} - x_k \geq 1/n$. Положим

$$f_1(x) = \begin{cases} A, & x \leq x_k, \\ B, & x > x_k, \end{cases}$$

и

$$f_2(x) = \begin{cases} A, & x < x_{k+1}, \\ B, & x \geq x_{k+1}. \end{cases}$$

Тогда

$$\int_0^1 f_1(x) dx = Ax_k + B(1 - x_k),$$

$$\int_0^1 f_2(x) dx = Ax_{k+1} + B(1 - x_{k+1})$$

и

$$q(f_1) = q(f_2).$$

Следовательно,

$$\begin{aligned}
 & \sup_{f \in M_{A,B}} \delta^H \left(\int_0^1 f(x) dx, q(f) \right) \geq \\
 & \geq \max \left\{ \delta^H \left(\int_0^1 f_1(x) dx, q(f_1) \right), \delta^H \left(\int_0^1 f_2(x) dx, q(f_2) \right) \right\} \geq \\
 & \geq \frac{1}{2} \left\{ \delta^H \left(\int_0^1 f_1(x) dx, q(f_1) \right) + \delta^H \left(\int_0^1 f_2(x) dx, q(f_2) \right) \right\} \geq \\
 & \geq \frac{1}{2} \delta^H \left(\int_0^1 f_1(x) dx, \int_0^1 f_2(x) dx \right) = \\
 & = \frac{1}{2} \delta^H (Ax_k + B(1-x_k), Ax_{k+1} + B(1-x_{k+1})).
 \end{aligned}$$

Рассмотрим $e(Ax_k + B(1-x_k), Ax_{k+1} + B(1-x_{k+1}))$. Используя теорему двойственности (см., например, [14], § 2.3), имеем

$$\begin{aligned}
 & e(Ax_k + B(1-x_k), Ax_{k+1} + B(1-x_{k+1})) = \\
 & = \sup_{z \in Ax_k + B(1-x_k)} \sup_{\|f\| \leq 1} \left\{ f(z) - \sup_{\omega \in Ax_{k+1} + B(1-x_{k+1})} f(\omega) \right\} = \\
 & = \sup_{\|f\| \leq 1} \left\{ \sup_{x \in A, y \in B} (x_k f(x) + (1-x_k) f(y)) - \sup_{u \in A, v \in B} (x_{k+1} f(u) + (1-x_{k+1}) f(v)) \right\} = \\
 & = \sup_{\|f\| \leq 1} (x_k h_A(f) + (1-x_k) h_B(f) - x_{k+1} h_A(f) - (1-x_{k+1}) h_B(f)) = \\
 & = \sup_{\|f\| \leq 1} ((x_k - x_{k+1}) h_A(f) + (x_{k+1} - x_k) h_B(f)) = \\
 & = (x_{k+1} - x_k) \sup_{\|f\| \leq 1} (h_B(f) - h_A(f)) = (x_{k+1} - x_k) e(B, A).
 \end{aligned}$$

Аналогично

$$\begin{aligned}
 & e(Ax_{k+1} + B(1-x_{k+1}), Ax_k + B(1-x_k)) = \\
 & = \sup_{z \in Ax_{k+1} + B(1-x_{k+1})} \sup_{\|f\| \leq 1} \left\{ f(z) - \sup_{\omega \in Ax_k + B(1-x_k)} f(\omega) \right\} = \\
 & = \sup_{\|f\| \leq 1} \left\{ \sup_{x \in A, y \in B} (x_{k+1} f(x) + (1-x_{k+1}) f(y)) - \sup_{u \in A, v \in B} (x_k f(u) + (1-x_k) f(v)) \right\} = \\
 & = \sup_{\|f\| \leq 1} (x_{k+1} h_A(f) + (1-x_{k+1}) h_B(f) - x_k h_A(f) - (1-x_k) h_B(f)) =
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
&= \sup_{\|f\| \leq 1} ((x_{k+1} - x_k)h_A(f) - (x_{k+1} - x_k)h_B(f)) = \\
&= (x_{k+1} - x_k) \sup_{\|f\| \leq 1} (h_A(f) - h_B(f)) = (x_{k+1} - x_k)e(A, B).
\end{aligned}$$

Поскольку B шире A , то $e(A, B) = 0$.

Таким образом, для любой квадратурной формулы $q \in Q$

$$\sup_{f \in M_{A,B}} \delta^H \left(\int_0^1 f(x) dx, q(f) \right) \geq \frac{1}{2} (x_{k+1} - x_k) \delta^H(A, B) \geq \frac{1}{2n} \delta^H(A, B).$$

Теорема доказана.

1. Борисович Ю. Г., Гельман Б. Д., Мышкис А. Д., Обуховский В. В. Многозначные отображения // Итоги науки и техники. Мат. анализ. – 1982. – **19**. – С. 127–230.
2. Борисович Ю. Г., Гельман Б. Д., Мышкис А. Д., Обуховский В. В. О новых результатах в теории многозначных отображений. I. Топологические характеристики и разрешимость операторных соотношений // Там же. – 1987. – **25**. – С. 123–197.
3. Гельман Б. Д., Обуховский В. В. О новых результатах в теории многозначных отображений. II. Анализ и приложения // Там же. – 1987. – **25**. – С. 107–159.
4. Vitale R. A. Approximations of convex set-valued functions // J. Approxim. Theory. – 1979. – **26**. – P. 301–316.
5. Zvi Artstein. Piecewise linear approximations of set-valued maps // Ibid. – 1989. – **56**. – P. 41–47.
6. Nira Dyn, Alona Mokhov. Approximations of set-valued functions based on the metric average // Rend. mat. Ser. VII. – 2006. – **26**. – P. 249–266.
7. Nira Dyn, Elza Farkhi. Approximations of set-valued functions with compact images – an overview, approximation and probability. – Warszawa: Banach Center Publ., 2006. – Vol. 72. – P. 1–14.
8. Nira Dyn, Elza Farkhi, Alona Mokhov. Approximations of set-valued functions by metric linear operators // Constr. Approxim. – 2007. – **25**. – P. 193–209.
9. Никольский С. М. Квадратурные формулы. – 4-е изд., доп. с добавлением Н. П. Корнейчука. – М.: Наука, 1988. – 256 с.
10. Zvi Artstein, John A. Burns. Integration of compact set-valued functions // Pacif. J. Math. – 1975. – **58**, № 2. – P. 297–306.
11. Hukuhara M. Integration des applications mesurables dont la Valeur est un compact convexe // Funkc. ekvacioj. – 1967. – **10**. – P. 205–223.
12. Kiefer J. Optimum sequential search and approximation methods under minimum regularity assumptions // J. Soc. Indust. Appl. Math. – 1957. – **5**, № 3. – P. 105–136.
13. Gruber P. M. Aspects of approximation of convex bodies // Handb. Convex Geometry / Eds P. M. Gruber, J. M. Wills. – 1993. – P. 319–345.
14. Корнейчук Н. П. Экстремальные задачи теории приближения. – М.: Наука, 1976. – 320 с.

Получено 06.08.10