

аналитических функций проведено В. Р. Кравчуком [3]. Д. Браесс [4] провел полное исследование строк матрицы наилучших рациональных приближений экспоненты на отрезке $[-1, 1]$.

В заключение выражаю глубокую благодарность В. Н. Русаку за постановку задачи и внимание к работе.

Список литературы

1. Русак В. Н. Докл. АН СССР. 1984. Т. 279. № 4. С. 810.
2. Русак В. Н. // Матем. сб. 1985. Т. 128. (170). Вып. 4. (12). С. 412.
3. Кравчук В. Р. РА-метод и его применение к приближению элементарных функций (Препринт 85.18 / АН УССР. Киев, 1985. С. 7.)
4. Braess Dietrich. On rational approximation of the exponential and the square root functions // Lect. Notes. N. 1105. P. 89.

Поступила в редакцию 03.03.86.

УДК 519.853.5

А. В. ЛУБОЧКИН

МЕТОД ПЕРВОГО ПОРЯДКА РЕШЕНИЯ ВЫПУКЛОЙ КУСОЧНО-ЛИНЕЙНОЙ СЕПАРАБЕЛЬНОЙ ЗАДАЧИ

Рассмотрим задачу

$$f(x) = \sum_{j \in J} c_j |x_j - \alpha_j| \rightarrow \min, \quad Ax = b, \quad d_* \leq x \leq d^*, \quad (1)$$

где $x = x(J) \in R^n$; $b = b(I) \in R^m$; $I = \{1, 2, \dots, m\}$; $J = \{1, 2, \dots, n\}$; $c = (c_j \geq 0, j \in J)$; $\text{rank } A = m$. Определения плана x , оптимального плана, опоры (ограничений) $J_{\text{оп}}$, опорного плана $\{x, J_{\text{оп}}\}$ традиционны*. Опорный план считается невырожденным, если $d_{*j} < x_j < d_j^*$, $j \in J_{\text{оп}}$; $x_j \neq \alpha_j$, $j \in J_{\text{с оп}} = J_c \cap J_{\text{оп}}$, $J_c = \{j \in J: c_j > 0\}$.

Пусть $\{x, J_{\text{оп}}\}$ — начальный опорный план; по нему построим вектор $s = A'u$, где $A'_{\text{оп}u} = c'_{\text{оп}}$, $A'_{\text{оп}} = A(I, J_{\text{оп}})$, $c'_{\text{оп}} = c^*(J_{\text{оп}})$, $c^* = c^*(J)$, $c^*(J_c^+) = c(J_c^+)$, $c^*(J_c^-) = -c(J_c^-)$, $c^*(J_0) = 0$, $J_0 = J \setminus J_c$, $J_c^+ = \{j \in J_c: x_j \geq \alpha_j\}$, $J_c^- = \{j \in J_c: x_j < \alpha_j\}$.

Критерий оптимальности. Соотношения $s_j \leq c_j \xi_j$ при $x_j = d_{*j}$; $s_j \geq c_j \xi_j$ при $x_j = d_j^*$; $s_j = c_j \xi_j$ при $x_j \neq \alpha_j$, $d_{*j} < x_j < d_j^*$; $|s_j| \leq c_j$ при $x_j = \alpha_j$, $d_{*j} < x_j < d_j^*$, $j \in J_{\text{н}} = J \setminus J_{\text{оп}}$, где $\xi_j = \text{sign}(x_j - \alpha_j)$, достаточны, а в случае невырожденности и необходимы, для оптимальности опорного плана $\{x, J_{\text{оп}}\}$ (здесь и далее $\text{sign}(d_{*j} - \alpha_j) = 1$, $\text{sign}(d_j^* - \alpha_j) = -1$).

Предположим, что для $\{x, J_{\text{оп}}\}$ критерий оптимальности не выполняется. Введем параметры метода (положительные числа): $\varepsilon, \mu_1, \mu_2$. Опишем итерацию метода. Положим вначале $v^0(J_{\text{н}}) = 0$, $p^0(J_{\text{н}}) = 0$, $x^0 = x$, $s^0 = s$, $k = 0$.

1. Построим вектор l^k : $l_j^k = d_{*j} - x_j^k$ при $s_j^k < c_j \xi_{*j}^k$; $l_j^k = d_j^* - x_j^k$ при $s_j^k > c_j \xi_j^k$, $j \in J_{\text{н}}$; $l_j^k = \alpha_j - x_j^k$ при $-c_j \leq s_j^k < c_j$, $x_j^k > \alpha_j$; $-c_j < s_j^k \leq c_j$, $x_j^k < \alpha_j$, $j \in J_{\text{с н}} = J_c \cap J_{\text{н}}$, $d_{*j} < \alpha_j < d_j^*$; $l_j^k = 0$ в остальных случаях, $j \in J_{\text{н}}$; $l^k(J_{\text{оп}}) = -A_{\text{оп}}^{-1} A(I, J_{\text{н}}) l^k(J_{\text{н}})$, где $\xi_{*j}^k = \text{sign}(d_{*j} - \alpha_j)$, $\xi_j^k = \text{sign}(d_j^* - \alpha_j)$.

2. Положим: $v_j^{k+1} \text{sign } l_j^k$, если $l_j^k \neq 0$; $v_j^{k+1} = v_j^k$, если $l_j^k = 0$; $p_j^{k+1} = p_j^k + 1$, если $v_j^{k+1} v_j^k < 0$; $p_j^{k+1} = p_j^k$, если $v_j^{k+1} v_j^k \geq 0$, $j \in J_{\text{н}}$. Подсчитаем шаг θ^k : $\theta^k = \min \{1, \theta_{\text{оп}}^k, \theta_a^k\}$; $\theta_{\text{оп}}^k = \min \theta_j^k$, $j \in J_{\text{оп}}$; $\theta_j^k = (d_{*j} - x_j^k) / l_j^k$,

* Р. Габасов, Ф. М. Кириллова. Методы линейного программирования. Минск, 1980. Ч. 3.