

逐次準線形化について

九大 経済 岩本 誠一 (Seiichi Iwamoto)

1. はじめに

1957年に R. Bellman が名著 "Dynamic Programming" [1] を発表して以来, 動的計画法について多くの研究がなされてきた。その本質は最適性の原理 Principle of Optimality をいわば自明のものとして認め, 以後の研究はこの原理を直接適用して種々の具体的な問題を解決して行く方向で進められてきたように思われる。しかし, 最適性の原理を理論的に扱えると, 2変数同時最適化は, 可分性と単調性の下では, 2段階逐次最適化によって保証されるということになる [8]。我々はこの2つの性質をひとつにまとめてより厳密に「非減少性をもつ再帰性」と言い換え [11], 簡単に「動的計画法構造」と呼ぶことにする [11]。この構造が動的計画法に現われる目的関数と制約関数を生成することができらるのである。

他方, 準線形化は Newton法に見られるように数値計算法に欠かせないものである [2]。特に, 凸関数に対する準線形化は, 最適化の面では, 理論的にはもちろん計算技法の上でも重要な役割りを果たしていることは言うまでもない。

本報告では準線形化を逐次適用して動的計画可能関数を生
成し、その最適化を論じる。ここでは準線形化を Bellman・
Karush [3-7] の最大変換の一般化と考えている。与えら
ぬ f は微分可能な狭義増加凸関数 $f(x)$ に対して逆関数 $f^{-1}(y)$ 、
共役関数 $f^*(y)$ および一次近似 $f(x; h)$ の反転関数 $f_1(x; k)$
により、それぞれ f の動的計画可能関数 $F(x; h)$ 、 $F^{-1}(y; k)$ 、
 $F^*(y; k)$ 、 $F_1(y; k)$ が生成される。これらの最適化された値
が合成関数 $f^N(h)$ 、 $f^{-N}(k)$ 、 $f^{*N}(k)$ 、 $f^{-N}(k)$ になることを示
す。反転関数は Newton 法と密接に関係しているが、他方、
最大変換の逆変換にもなっていることが分かる。

2. 問題

まず、次の有名な問題を考えよう [1, p.102; 8, p.121; 10, p.18]

$$\begin{aligned} \text{Max } & e^{x_1(1-x_1)} + e^{x_1+x_2(1-x_2)} + \dots + e^{x_1+x_2+\dots+x_{N-1}(1-x_N)} + e^{x_1+x_2+\dots+x_N} h \\ \text{s.t. } & -\infty < x_n < \infty \quad 1 \leq n \leq N \end{aligned} \quad (1)$$

ただし、 N は自然数、 h は実定数。

この目的関数の再帰性に着目すると、目的関数は2変数関
数

$$f(x; h) = e^x(1-x+h) \quad -\infty < x, h < \infty \quad (2)$$

を N 回合成した関数

$$f(x_1; f(x_2; \dots; f(x_N; h) \dots))$$

(3)

$$= e^{x_1(1-x_1)} + e^{x_1} [e^{x_2(1-x_2)} + e^{x_2} [\dots [e^{x_N(1-x_N)} + e^{x_N h}] \dots]]$$

なることいえることが分かる ([11, p.278; 12] 参照)。

次に、今度は逆に、例えば

$$f(x; h) = e^{x^2(1-2x^2+2xh)} \quad 0 \leq x, h < \infty \quad (4)$$

として、これを3回合成した関数

$$f(x_1; f(x_2; f(x_3; h)))$$

$$= e^{x_1^2(1-2x_1^2)} + 2x_1 e^{x_1^2} [e^{x_2^2(1-2x_2^2)} + 2x_2 e^{x_2^2} [e^{x_3^2(1-2x_3^2)} + 2x_3 e^{x_3^2 h}]]] \quad (5)$$

を目的関数にもつ最大化問題

$$\begin{aligned} \text{Max} \quad & e^{x_1^2(1-2x_1^2)} + 2x_1 e^{x_1^2+x_2^2} (1-2x_2^2) + 4x_1 x_2 e^{x_1^2+x_2^2+x_3^2} (1-2x_3^2) \\ & + 8x_1 x_2 x_3 e^{x_1^2+x_2^2+x_3^2} h \end{aligned} \quad (6)$$

$$\text{s.t.} \quad x_1 \geq 0, x_2 \geq 0, x_3 \geq 0$$

を考えよう。ただし $h \geq 0$ 。

この2つの目的関数は N 次元ユークリッド空間 R^N (または3次元正象限 R_+^3) 上の狭義増加性をもつ再帰型関数と呼ばれている [10]。これらの最大化はどうなるのだろうか。実は、2つの問題では、 $f(x) = e^x$, $f(x) = e^{x^2}$ とすると、 $f(x; h)$ は $f(x)$ の h における1次近似 (線形化)

$$f(x; h) = f(x) + f'(x)(h-x) \quad (7)$$

になっている。

3. 主な結果

まず次の基本的な補題を準備しよう。

X, Y を空でない集合とし, $X \ni$ 各 x に対し $Y(x)$ を Y の空でない部分集合とする。すなわち $Y(\cdot): X \rightarrow 2^Y$ を点対集合値写像とする。ただし 2^Y は集合 Y の空でない部分集合の全体とする。集合値写像 $Y(\cdot)$ のグラフを

$$Gr(Y) = \{(x, y) \mid y \in Y(x), x \in X\} \subset X \times Y \quad (8)$$

で定義する。

補題 1 (マクシマックス定理 [11; p.268]) 関数 $f: X \times R^1 \rightarrow R^1$ は各 $x \in X$ に対して $f(x; \cdot): R^1 \rightarrow R^1$ が非減少とする。関数 g は $g: Gr(Y) \rightarrow R^1$ とする。このとき, $\text{Max}_{x \in X} f(x; \text{Max}_{y \in Y(x)} g(x, y))$ が存在すれば, $\text{Max}_{(x, y) \in Gr(Y)} f(x; g(x, y))$ も存在して, 両者は等しい。

$$\text{Max}_{x \in X} f(x; \text{Max}_{y \in Y(x)} g(x, y)) = \text{Max}_{(x, y) \in Gr(Y)} f(x; g(x, y)). \quad (9)$$

注. この等号は, Max を min に替えても, この条件のままで

成り立つ。さらに、特別な場合には

$$\text{Max}_{x \in R^1} f(x; \text{Max}_{y \in R^1} g(y)) = \text{Max}_{x, y \in R^1} f(x; g(y)) \quad (10)$$

になる。

一般に、任意の微分可能な凸関数

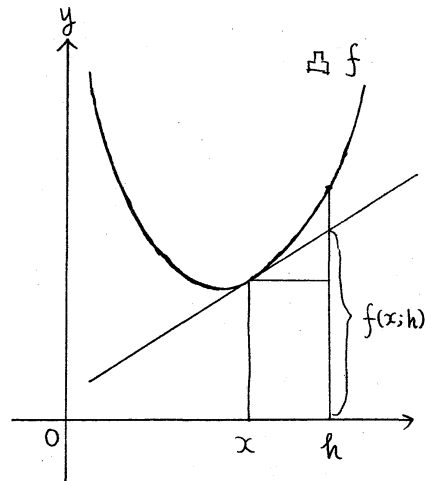
$f: R^1 \rightarrow R^1$ に対して

$$\begin{aligned} f(h) &= \text{Max}_{x \in R^1} [f(x) + (h-x)f'(x)] \\ &= \text{Max}_{x \in R^1} [F(x) + f'(x)h] \quad (11) \\ &= \text{Max}_{x \in R^1} f(x; h) \end{aligned}$$

が成り立つ (図1)。ただし

$$F(x) = f(x) - x f'(x)$$

$$f(x; h) = F(x) + f'(x)h.$$



(12)

図1

表現(11)は関数 $f(h)$ の 準線形化 である ([1; p.135]). さらに、補題1より、 $f'(x) \geq 0 \quad x \in R^1$ の下では

$$\begin{aligned} f(f(h)) &= \text{Max}_{x_1 \in R^1} [F(x_1) + f'(x_1)f(h)] \\ &= \text{Max}_{x_1 \in R^1} [F(x_1) + f'(x_1) [\text{Max}_{x_2 \in R^1} [F(x_2) + f'(x_2)h]]] \\ &= \text{Max}_{x_1, x_2 \in R^1} [F(x_1) + f'(x_1)F(x_2) + f'(x_1)f'(x_2)h] \quad (13) \end{aligned}$$

$$= \text{Max}_{x_1, x_2 \in R^1} f(x_1; f(x_2; h))$$

が成り立つ。したがって、関数 $f: R^1 \rightarrow R^1$ と自然数 N に対して

$$F(x; h) = f(x_1; f(x_2; \dots; f(x_N; h) \dots)) \quad (14)$$

$$x = (x_1, x_2, \dots, x_N) \in R^N$$

とすれば、次の定理を得る。

定理 1 (i) 関数 $f: R^1 \rightarrow R^1$ が微分可能な増加凸ならば、各 $h \in R^1$ に対して

$$f^N(h) = \text{Max}_{x \in R^N} F(x; h) \quad (15)$$

かつ $x_1^* = f^N(h)$, $x_2^* = f^{N-2}(h)$, \dots , $x_{N-1}^* = f(h)$, $x_N^* = h$ が最大値に到達する。

(ii) 関数 $g: R^1 \rightarrow R^1$ が微分可能な増加凹ならば、各 $k \in R^1$ に対して

$$g^N(k) = \min_{y \in R^N} G(y; k) \quad (16)$$

かつ $\hat{y}_1 = g^{N-1}(k)$, $\hat{y}_2 = g^{N-2}(k)$, \dots , $\hat{y}_{N-1} = g(k)$, $\hat{y}_N = k$ が最小値に到達する。また

$$f^m(x) = f(f(\dots f(x) \dots))$$

$$G(y; k) = g(y_1; g(y_2; \dots; g(y_N; k) \dots)) \quad (17)$$

$$g(y; k) = G(y) + g'(y)k$$

$$G(y) = g(y) - y g'(y)$$

$$y = (y_1, y_2, \dots, y_N).$$

注. 定理1の目的関数はそれぞれ

$$F(x; h) = F(x_1) + f'(x_1)F(x_2) + \dots + f'(x_1)f'(x_2)\dots f'(x_{N-1})F(x_N) \\ + f'(x_1)f'(x_2)\dots f'(x_N)h, \quad (18)$$

$$G(y; k) = G(y_1) + g'(y_1)G(y_2) + \dots + g'(y_1)g'(y_2)\dots g'(y_{N-1})G(y_N) \\ + g'(y_1)g'(y_2)\dots g'(y_N)k \quad (19)$$

で表される。

4. 逆と反転と共役と

まず逆を考えよう。関数 $f: R^1 \rightarrow R^1$ が上への微分可能な狭義増加凸であるための必要十分条件は、逆関数 $f^{-1}: R^1 \rightarrow R^1$ が上への微分可能な狭義増加凹であるから、次の系が得られる。

系 (i) 関数 $f: R^1 \rightarrow R^1$ が上への微分可能な狭義増加凸ならば、各 $k \in R^1$ に対して

$$f^{-N}(k) = \min_{y \in R^N} F^{-1}(y; k) \quad (20)$$

かつ $\hat{y}_1 = f^{-N+1}(k)$, $\hat{y}_2 = f^{-N+2}(k)$, \dots , $\hat{y}_{N-1} = f^{-1}(k)$, $\hat{y}_N = k$ が最小点である。ただし

$$f^{-N}(y) = f^{-1}(f^{-1}(\dots f^{-1}(y)\dots))$$

$$F^{-1}(y) = f^{-1}(y) - y f^{-1}'(y)$$

$$f^{-1}(y; k) = F^{-1}(y) + f^{-1}'(y)k \quad (21)$$

$$F^{-1}(y; k) = f^{-1}(y_1; f^{-1}(y_2; \dots; f^{-1}(y_N; k) \dots))$$

(ii) 関数 $g: R^1 \rightarrow R^1$ かつ \wedge の微分可能な狭義増加凹ならば、各 $h \in R^1$ に対し

$$g^{-N}(h) = \text{Max}_{x \in R^N} G^{-1}(x; h) \quad (22)$$

かつ $x_1^* = g^{-N+1}(h)$, $x_2^* = g^{-N+2}(h)$, \dots , $x_{N-1}^* = g^{-1}(h)$, $x_N^* = h$ かつ最大点である。ただし

$$G^{-1}(x) = g^{-1}(x) - x g^{-1}'(x)$$

$$g^{-1}(x; h) = G^{-1}(x) + g^{-1}'(x)h \quad (23)$$

$$G^{-1}(x; h) = g^{-1}(x_1; g^{-1}(x_2; \dots; g^{-1}(x_N; h) \dots))$$

注. 系中の目的関数は次のようになる。

$$F^{-1}(y; k) = F^{-1}(y_1) + f^{-1}'(y_1)F^{-1}(y_2) + \dots + f^{-1}'(y_1)f^{-1}'(y_2)\dots f^{-1}'(y_{N-1})F^{-1}(y_N)$$

$$+ f^{-1}'(y_1)f^{-1}'(y_2)\dots f^{-1}'(y_N)k \quad (24)$$

$$G^{-1}(x; h) = G^{-1}(x_1) + g^{-1}'(x_1)G^{-1}(x_2) + \dots + g^{-1}'(x_1)g^{-1}'(x_2)\dots g^{-1}'(x_{N-1})G^{-1}(x_N)$$

$$+ g^{-1}'(x_1)g^{-1}'(x_2)\dots g^{-1}'(x_N)h \quad (25)$$

次に、2変数関数 $f(x; h)$ の反転を考へよう。任意の微分

可能な狭義増加凸関数 $f: \mathbb{R}^1 \rightarrow \mathbb{R}^1$ に対して

$$\begin{aligned} f(x; h) &= f(x) + (h-x)f'(x) \\ &= F(x) + f'(x)h \end{aligned} \quad (26)$$

で定義した 2変数関数 $f(x; h)$ は、各 $x \in \mathbb{R}^1$ を固定すると h の連続狭義増加関数だから、その逆関数 $f_{-1}(x; \cdot)$ が

$$\begin{aligned} f_{-1}(x; k) &= x - \frac{f(x)}{f'(x)} + \frac{k}{f'(x)} \\ &= F_{-1}(x) + \frac{k}{f'(x)} \end{aligned} \quad (27)$$

として定義される。ただし

$$F_{-1}(x) = x - \frac{f(x)}{f'(x)}. \quad (28)$$

$f_{-1}(x; k)$ を $f(x; h)$ の反転関数 (reverse function) とする。

準線形化技法によれば、微分可能な狭義増加凸 f に対して

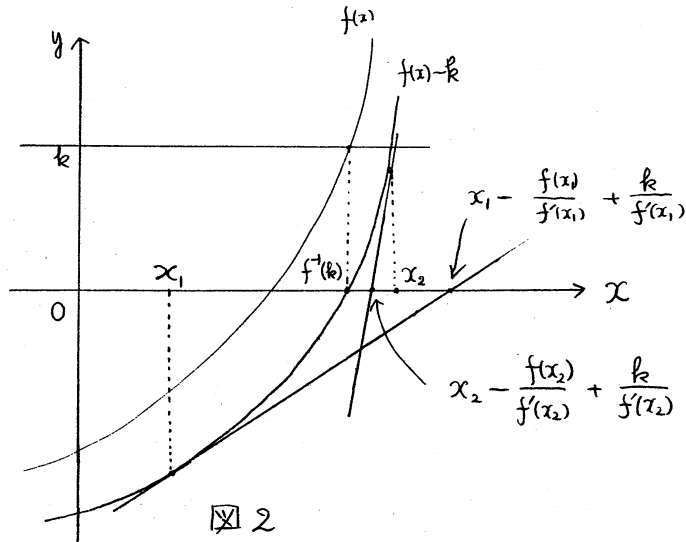
$$\begin{aligned} f(h) &= \max_{x \in \mathbb{R}^1} f(x; h) \\ &= \max_{x \in \mathbb{R}^1} [F(x) + f'(x)h] \quad h \in \mathbb{R}^1 \quad (29) \\ &= \max_{x \in \mathbb{R}^1} [f(x) - x f'(x) + f'(x)h] \end{aligned}$$

かつ $x^* = h$ が最大点であった。これはまた次に同値である。

$$\begin{aligned} f^+(k) &= \min_{x \in \mathbb{R}^1} f_{-1}(x; k) \\ &= \min_{x \in \mathbb{R}^1} [F_{-1}(x) + \frac{k}{f'(x)}] \end{aligned} \quad (30)$$

$$= \min_{x \in \mathbb{R}^1} \left[x - \frac{f(x)}{f'(x)} + \frac{k}{f'(x)} \right]$$

かつ $\hat{x} = f^{-1}(k)$ が最小点である(図2)。この事実は, Newton



法の考え方を最適化の立場から見直したことになっている。

定理2 (i) 関数 $f: \mathbb{R}^1 \rightarrow \mathbb{R}^1$ が微分可能な狭義増加凸ならば, 各 $k \in \mathbb{R}^1$ に対して

$$f^{-N}(k) = \min_{x \in \mathbb{R}^N} F_{-1}(x; k) \tag{31}$$

かつ $\hat{x}_1 = f^{-N}(k), \hat{x}_2 = f^{-N+1}(k), \dots, \hat{x}_{N-1} = f^{-2}(k), \hat{x}_N = f^{-1}(k)$ は最小点である。ただし

$$F_{-1}(x; k) = f_{-1}(x_1; f_{-1}(x_2; \dots; f_{-1}(x_N; k) \dots)). \tag{32}$$

(ii) 関数 $g: \mathbb{R}^1 \rightarrow \mathbb{R}^1$ が微分可能な狭義増加凹ならば, 各 $h \in \mathbb{R}^1$ に対して

$$g^{-N}(h) = \text{Max}_{y \in \mathbb{R}^N} G_{-1}(y; h) \tag{33}$$

かゝ $y_1^* = g^{-N}(h)$, $y_2^* = g^{-N+1}(h)$, ..., $y_{N-1}^* = g^{-2}(h)$, $y_N^* = g^{-1}(h)$ は最大点である。左に

$$G_{-1}(y) = y - \frac{g(y)}{g'(y)}$$

$$g_{-1}(y; h) = G_{-1}(y) + \frac{h}{g'(y)} \quad (34)$$

$$G_{-1}(y; h) = g_{-1}(y_1; g_{-1}(y_2; \dots; g_{-1}(y_N; h) \dots)).$$

注. 定理 2 の目的関数は次になる。

$$F_{-1}(x; k) = F_{-1}(x_1) + \frac{F_{-1}(x_2)}{f'(x_1)} + \dots + \frac{F_{-1}(x_N)}{f'(x_1)f'(x_2)\dots f'(x_{N-1})}$$

$$+ \frac{k}{f'(x_1)f'(x_2)\dots f'(x_N)} \quad (35)$$

$$G_{-1}(y; h) = G_{-1}(y_1) + \frac{G_{-1}(y_2)}{g'(y_1)} + \dots + \frac{G_{-1}(y_N)}{g'(y_1)g'(y_2)\dots g'(y_{N-1})}$$

$$+ \frac{h}{g'(y_1)g'(y_2)\dots g'(y_N)} \quad (36)$$

定理 3 (i) 関数 $f: R^1 \rightarrow R^1$ は上への微分可能な狭義増加凸とすると, 単調変換 $y = f(x)$ により $F^{-1}(y; k)$ は $F_{-1}(x; k)$ になる。また, 単調変換 $y_n = f(x_n)$ $1 \leq n \leq N$ により $F^{-1}(y; k)$ は $F_{-1}(x; k)$ になる。

(ii) 関数 $g: R^1 \rightarrow R^1$ は上への微分可能な狭義増加凹とす

よと, 単調変換 $x = g(y)$ によつて $G^{-1}(x; h)$ は $G_L(y; h)$ になる。また, 単調変換 $x_m = g(y_m) \quad 1 \leq m \leq N$ によつて $G^{-1}(x; h)$ は $G_L(y; h)$ になる。

最後に, 共役作用素 $*$ と \wedge を考えよう。一般に, 任意の凸関数 $f: R^1 \rightarrow R^1$ にその共役関数 f^* を

$$f^*(y) = \sup_{x \in R^1} [xy - f(x)] \quad y \in R^1 \quad (37)$$

で定義し, 凹関数 $g: R^1 \rightarrow R^1$ に対してはその共役関数 \hat{g} を

$$\hat{g}(x) = \inf_{y \in R^1} [yx - g(y)] \quad x \in R^1 \quad (38)$$

で定める。作用 $*$ と \wedge は次の意味で双対をなしている。

$$\widehat{(\hat{f})}(y) = -f^*(-y) \quad y \in R^1 \quad (39)$$

補題 2 関数 $f: R^1 \rightarrow R^1$ は 2 回微分可能で狭義増加・狭義凸とする。このとき, $f'(-\infty) < y < f'(\infty)$ に対して次が成り立つ。

$$(i) \quad f^*(y) = xy - f(x)$$

$$(ii) \quad f^{*'}(y) = x, \quad \text{特に } f^{*''}(y) > 0 \quad (f'(0) < y < f'(\infty) \text{ のとき}) \quad (40)$$

$$(iii) \quad f^{*''}(y) = \frac{1}{f''(x)} > 0$$

ただし x は $f'(x) = y$ を満たす (唯一) の実数。

したがって, $f^*: (f'(0), f'(\infty)) \rightarrow R^1$ は狭義増加・狭義凸であるから, 次の定理が得られる。

定理 4 関数 $f: \mathbb{R}^1 \rightarrow \mathbb{R}^1$ は 2 回微分可能で狭義増加・狭義凸とするとき、 $f'(0) < f^{*n}(h) < f'(\infty)$ $n=1, 2, \dots, N-1$ なる h に対して

$$f^{*N}(h) = \text{Max}_{\substack{f'(0) < y_n < f'(\infty) \\ 1 \leq n \leq N}} F^*(y; h) \quad (41)$$

かつ $y_1^* = f^{*(N-1)}(h)$, $y_2^* = f^{*(N-2)}(h)$, \dots , $y_{N-1}^* = f^*(h)$, $y_N^* = h$ は最大点である。ただし

$$F^*(y) = f^*(y) - y f^{*'}(y)$$

$$f^*(y; h) = F^*(y) + f^{*'}(y) h \quad (42)$$

$$F^*(y; h) = f^*(y_1; f^*(y_2; \dots; f^*(y_N; h) \dots))$$

注. この目的関数は

$$F^*(y; h) = F^*(y_1) + f^{*'}(y_1) F^*(y_2) + \dots + f^{*'}(y_1) f^{*'}(y_2) \dots f^{*'}(y_{N-1}) F^*(y_N) + f^{*'}(y_1) f^{*'}(y_2) \dots f^{*'}(y_N) h. \quad (43)$$

同様に凹関数については次のとおり。

補題 3 関数 $g: \mathbb{R}^1 \rightarrow \mathbb{R}^1$ は 2 回微分可能で狭義増加・狭義凹とする。このとき、 $g'(\infty) < x < g'(0)$ なる x に対して次が成り立つ。

$$(i) \hat{g}'(x) = yx - g(y)$$

$$(ii) \hat{g}'(x) = y, \text{ 特 } \hat{g}'(x) > 0 \quad (g'(\infty) < x < g'(0) \text{ のとき}) \quad (44)$$

$$(iii) \quad \hat{g}''(x) = \frac{1}{g''(y)} < 0$$

ただし y は一意に $g'(y) = x$ を満たすもの。

定理5 関数 $g: R^1 \rightarrow R^1$ は2回微分可能で狭義増加・狭義凹とすると, $g'(\infty) < \hat{g}^m(k) < g'(0)$ $m=1, 2, \dots, N-1$ なる k に対して

$$\hat{g}^N(k) = \min_{\substack{g'(\infty) < x_m < g'(0) \\ 1 \leq m \leq N}} \hat{G}(x; k) \quad (45)$$

かつ $\hat{x}_1 = \hat{g}^{N-1}(k)$, $\hat{x}_2 = \hat{g}^{N-2}(k)$, \dots , $\hat{x}_{N-1} = \hat{g}(k)$, $\hat{x}_N = k$ は最小点である。ただし

$$\begin{aligned} \hat{G}(x) &= \hat{g}(x) - x \hat{g}'(x) \\ \hat{g}(x; k) &= \hat{G}(x) + \hat{g}'(x) k \\ \hat{G}(x; k) &= \hat{g}(x_1; \hat{g}(x_2; \dots; \hat{g}(x_N; k) \dots)). \end{aligned} \quad (46)$$

注. 目的関数は次のように表される。

$$\begin{aligned} \hat{G}(x; k) &= \hat{G}(x_1) + \hat{g}'(x_1) \hat{G}(x_2) + \dots + \hat{g}'(x_1) \hat{g}'(x_2) \dots \hat{g}'(x_{N-1}) \hat{G}(x_N) \\ &\quad + \hat{g}'(x_1) \hat{g}'(x_2) \dots \hat{g}'(x_N) k. \end{aligned} \quad (47)$$

5. 例題

5.1 $f(x) = e^x : (-\infty, \infty) \rightarrow (0, \infty)$

この場合は次のようになる。

$$f(x; h) = (1-x+h)e^x \quad -\infty < x, h < \infty \quad (48)$$

$$F(x; h) = e^{x_1}(1-x_1) + e^{x_1+x_2}(1-x_2) + \cdots + e^{x_1+x_2+\cdots+x_{N-1}}(1-x_N) \\ + e^{x_1+x_2+\cdots+x_N} h \\ -\infty < x_n, h < \infty.$$

これは第2節冒頭の向題(1), (2)である。逆にすると

$$g(y) = f^{-1}(y) = \log y : (0, \infty) \rightarrow (-\infty, \infty)$$

$$g(y; k) = f^{-1}(y; k) = -1 + \log y + \frac{k}{y} \quad 0 < y, k < \infty \quad (49)$$

$$G(y; k) = F^{-1}(y; k) = -1 + \log y_1 + \frac{-1 + \log y_2}{y_1} + \cdots + \frac{-1 + \log y_N}{y_1 y_2 \cdots y_{N-1}} \\ + \frac{k}{y_1 y_2 \cdots y_N}$$

$$0 < y_n < \infty, \quad k \gg 0$$

にある。ただし $k \gg 0$ は k が十分大なる正数であることを示す。ここには $\log \log \cdots \log k$ ($(N-1)$ 回 \log 作用) が well-defined になる程の正数。すなわち $k > e^{e^{\cdots e}}$ ($(N-1)$ 個の e)。反転は

$$f_-(x; k) = x-1 + e^{-x} k \quad -\infty < x < \infty, \quad 0 < k < \infty$$

$$F_-(x; k) = x_1-1 + e^{-x_1}(x_2-1) + \cdots + e^{-x_1-x_2-\cdots-x_{N-1}}(x_N-1) \\ + e^{-x_1-x_2-\cdots-x_N} k \quad -\infty < x_n < \infty \\ k \gg 0. \quad (50)$$

さらに共役になると

$$f^*(y) = (-1 + \log y)y : (0, \infty) \rightarrow [-1, \infty)$$

$$f^*(y) = \log y > 0 \quad 1 < y < \infty \quad (51)$$

$$f^{**}(y) = 1/y > 0$$

$$f^*(y; k) = -y + k \log y \quad y > 1, k > 1 \quad (52)$$

$$F^*(y; k) = -y_1 - y_2 \log y_1 - \dots - y_N \log y_1 \log y_2 \dots \log y_{N-1} \\ + k \log y_1 \log y_2 \dots \log y_N \quad y_n > 1 \\ k > e^2$$

$$\hat{g}(x) = 1 + \log x \quad (0, \infty) \rightarrow (-\infty, \infty)$$

$$\hat{g}(x; h) = \log x + \frac{h}{x} \quad 0 < x, h < \infty \quad (53)$$

$$\hat{G}(x; h) = \log x_1 + \frac{\log x_2}{x_1} + \dots + \frac{\log x_N}{x_1 x_2 \dots x_{N-1}} + \frac{h}{x_1 x_2 \dots x_N}$$

$$x_n > 0, \quad h > e^{-1} + e^{-1+e} + \dots + e^{-1+e^{N-1}} \quad (N \text{ 回 } a \text{ の } c)$$

に在る。

関数 $f(x)$ の逆関数 $g(y) = f^{-1}(y)$ から生成された $g(y; k)$ の反転は

$$g_{-1}(x; h) = y(1 - \log y) + y h \quad y > 0, -\infty < h < \infty \quad (54)$$

$$G_{-1}(x; h) = y_1(1 - \log y_1) + y_1 y_2(1 - \log y_2) + \dots + y_1 y_2 \dots y_N(1 - \log y_N) \\ + y_1 y_2 \dots y_N h$$

$$y_n > 0, -\infty < h < \infty,$$

また $\hat{g}(x; h)$ の反転は

$$\hat{g}_{-1}(x; k) = -x \log x + x k \quad x > 0,$$

$$\hat{G}_{-1}(x; k) = -x_1 \log x_1 - x_1 x_2 \log x_2 - \dots - x_1 x_2 \dots x_N \log x_N \\ + x_1 x_2 \dots x_N k, \quad x_n > 0, -\infty < k < \infty. \quad (55)$$

$$5.2 \quad f(x) = x^2 : [0, \infty) \rightarrow [0, \infty)$$

この場合は

$$f(x; h) = -x^2 + 2xh \quad x, h \geq 0 \quad (56)$$

$$F(x; h) = -x_1^2 - 2x_1 x_2^2 - \dots - 2^{N-1} x_1 x_2 \dots x_{N-1} x_N^2 \\ + 2^N x_1 x_2 \dots x_N h \quad \begin{array}{l} x_n \geq 0 \\ h \geq 0 \end{array}$$

つまり、特に $N=1$ のとき 定理 1 は

$$\text{Max}_{-\infty < x < \infty} [2xh - x^2] = h^2 \quad -\infty < h < \infty \quad (57)$$

を主張している。これは最も簡単な準線形化 ([1] p.134)

である。逆は次のようになる。

$$g(y) = f^{-1}(y) = \sqrt{y} : (0, \infty) \rightarrow (0, \infty)$$

$$g(y; k) = f^{-1}(y; k) = \frac{1}{2} \left(\sqrt{y} + \frac{k}{\sqrt{y}} \right) \quad y, k > 0 \quad (58)$$

$$G(y; k) = F^{-1}(y; k) = \frac{1}{2} \sqrt{y_1} + \frac{1}{2^2} \sqrt{\frac{y_2}{y_1}} + \dots + \frac{1}{2^N} \sqrt{\frac{y_N}{y_1 y_2 \dots y_{N-1}}} \\ + \frac{k}{2^N \sqrt{y_1 y_2 \dots y_N}}, \quad y_n > 0, k > 0$$

$N=1$ のとき、系 (ii) は

$$\min_{x > 0} \left[\frac{1}{2} \sqrt{x} + \frac{k}{2\sqrt{x}} \right] = \sqrt{k} \quad k > 0 \quad (59)$$

である ([1] p.134)。反転については

$$f_1(x; k) = \frac{1}{2} \left(x + \frac{k}{x} \right) \quad x, k > 0$$

$$F_1(x; k) = \frac{1}{2}x_1 + \frac{1}{2^2}\frac{x_2}{x_1} + \cdots + \frac{1}{2^N}\frac{x_N}{x_1x_2\cdots x_{N-1}} + \frac{k}{2^N x_1x_2\cdots x_N} \quad (60)$$

$x_n > 0, k > 0.$

共役は

$$f^*(y) = \frac{1}{4}y^2 : [0, \infty) \rightarrow [0, \infty)$$

$$f^*(y; k) = -\frac{1}{4}y^2 + yk \quad y \geq 0, k \geq 0 \quad (61)$$

$$F^*(y; k) = -\frac{1}{4}y_1^2 - \frac{1}{4 \cdot 2}y_1y_2^2 - \cdots - \frac{1}{4 \cdot 2^{N-1}}y_1y_2\cdots y_{N-1}y_N^2 + \frac{1}{2^N}y_1y_2\cdots y_Nk, \\ y_n \geq 0, k \geq 0$$

$$\hat{g}(x) = -\frac{1}{4x} : (0, \infty) \rightarrow (-\infty, 0)$$

$$\hat{g}(x; h) = -\frac{1}{2x} + \frac{h}{4x^2} \quad x > 0, h > 0 \quad (62)$$

1. 2. 3. 4. 5.

$$\hat{g}(h) = \min_{0 < x < \infty} \hat{g}(x; h) \quad h > 0 \quad (63)$$

は成立するが、 $N \geq 2$ の場合は

$$\hat{g}^N(h) = \min_{0 < x_n < \infty} \hat{G}(x; h) \quad h > 0 \quad (64)$$

は成立しない。なぜなら $\hat{g}(h) < 0$ なるから。

$$5.3 \quad f(x) = x + \sqrt{\varepsilon^2 x^2 + 1} : (-\infty, \infty) \rightarrow (-\infty, \infty) \quad 0 < \varepsilon < 1$$

これは

$$f'(x) = 1 + \frac{\varepsilon^2 x}{\sqrt{\varepsilon^2 x^2 + 1}} > 0$$

(65)

$$f''(x) = \frac{\varepsilon^2}{(\varepsilon^2 x^2 + 1)^{3/2}} > 0$$

だから 狭義増加・狭義凸である。また

$$f(x; h) = \frac{1}{\sqrt{\varepsilon^2 x^2 + 1}} + \left(1 + \frac{\varepsilon^2 x}{\sqrt{\varepsilon^2 x^2 + 1}}\right) h \quad -\infty < x, h < \infty \quad (66)$$

$$g(y) = f^{-1}(y) = \frac{y - \sqrt{\varepsilon^2 y^2 + (1 - \varepsilon^2)}}{1 - \varepsilon^2} : (-\infty, \infty) \rightarrow (-\infty, \infty)$$

になる。 $F = F(x; h)$, $F^{-1} = G$, F_{-1} , G_{-1} , f^* , \hat{f} , F^* , \hat{G}
... は省略。

$$5.4 \quad g(y) = y - \sqrt{\varepsilon^2 y^2 + 1} : (-\infty, \infty) \rightarrow (-\infty, \infty) \quad 0 < \varepsilon < 1$$

$$g'(y) = 1 - \frac{\varepsilon^2 y}{\sqrt{\varepsilon^2 y^2 + 1}} > 0 \quad (67)$$

$$g''(y) = -\frac{\varepsilon^2}{(\varepsilon^2 y^2 + 1)^{3/2}} < 0$$

だから, g は 狭義増加・狭義凹である。また

$$g(y; k) = -\frac{1}{\sqrt{\varepsilon^2 y^2 + 1}} + \left(1 - \frac{\varepsilon^2 y}{\sqrt{\varepsilon^2 y^2 + 1}}\right) k \quad -\infty < y, k < \infty \quad (68)$$

$$f(x) = g^{-1}(x) = \frac{x + \sqrt{\varepsilon^2 x^2 + (1 - \varepsilon^2)}}{1 - \varepsilon^2} : (-\infty, \infty) \rightarrow (-\infty, \infty).$$

他の関数は省略。

$$5.5 \quad p(x) = -f(-x) \quad \text{だから} \quad f'(x) > 0, \quad f''(x) > 0$$

関数 $f: (-\infty, \infty) \rightarrow (-\infty, \infty)$ は 2回微分可能な狭義増加・狭義凸とすると, $p(x) = -f(-x) : (-\infty, \infty) \rightarrow (-\infty, \infty)$ は,

$$p'(x) = f'(-x) > 0, \quad p''(x) = -f''(-x) < 0 \quad (69)$$

だからやはり 2回微分可能で狭義増加・狭義凹になる。さらに

$$P(x) = -F(-x)$$

$$p(x; k) = -f(-x; -k) \quad (70)$$

$$P(x; k) = -F(-x; -k)$$

である。したがって

$$\min_{x \in \mathbb{R}^N} P(x; k)$$

$$= -\max_{x \in \mathbb{R}^N} F(x; -k)$$

$$= -f^N(-k)$$

$$= p^N(k)$$

(71)

が得られる。

6. おわりに

1. 定理 1(i) は 次のように不等式で同値表現できる。

関数 $f: \mathbb{R}^1 \rightarrow \mathbb{R}^1$ が微分可能な増加凸ならば、各 $h \in \mathbb{R}^1$ に対して

$$F(x; h) \leq f^N(h) \quad x \in \mathbb{R}^N \quad (72)$$

かつ等号が成立する必要十分条件は

$$x_1 = f^{N-1}(h), x_2 = f^{N-2}(h), \dots, x_{N-1} = f(h), x_N = h \quad (73)$$

である。

2. 定理 1(i) の非定常な場合は次になる。

$$f_1(f_2(\dots f_N(h)\dots)) = \max_{\substack{-\infty < x_n < \infty \\ 1 \leq n \leq N}} \left[F_1(x_1) + f_1'(x_1)F_2(x_2) + \dots + f_1'(x_1)f_2'(x_2)\dots f_{N-1}'(x_{N-1})F_N(x_N) \right. \\ \left. + f_1'(x_1)f_2'(x_2)\dots f_N'(x_N)h \right] \quad (74)$$

3. 定理1(i)を N 変数関数 $f: R^N \rightarrow R^1$ ($N \geq 2$)に直接拡張することは容易ではない。補題1のマクシミックス定理が2の場合成立しないからである。

4. 定理1(i),(ii)のミニマックス化は可能である。すなわち、関数 $f(g): R^1 \rightarrow R^1$ が微分可能な増加凸(凹)ならば、

$$\begin{aligned} & \text{Max}_{-\infty < x < \infty} \min_{-\infty < y < \infty} [F(x) + f(x)G(y) + f'(x)g'(y)l] \\ &= \min_{-\infty < y < \infty} \text{Max}_{-\infty < x < \infty} [\dots] \quad (75) \\ &= f(g(l)) \quad -\infty < l < \infty \end{aligned}$$

かつ点 $(x^*, \hat{y}) = (g(l), l)$ は鞍点である ([11; p.278-281])。

例として、 $f(x) = e^x$ ($-\infty < x < \infty$)、 $g(y) = \log y$ ($y > 0$) とすると

$$\begin{aligned} & \text{Max}_{-\infty < x < \infty} \min_{y > 0} e^x (-x + \log y + \frac{l}{y}) \\ &= \min_{y > 0} \text{Max}_{-\infty < x < \infty} [\dots] \quad (76) \\ &= l \end{aligned}$$

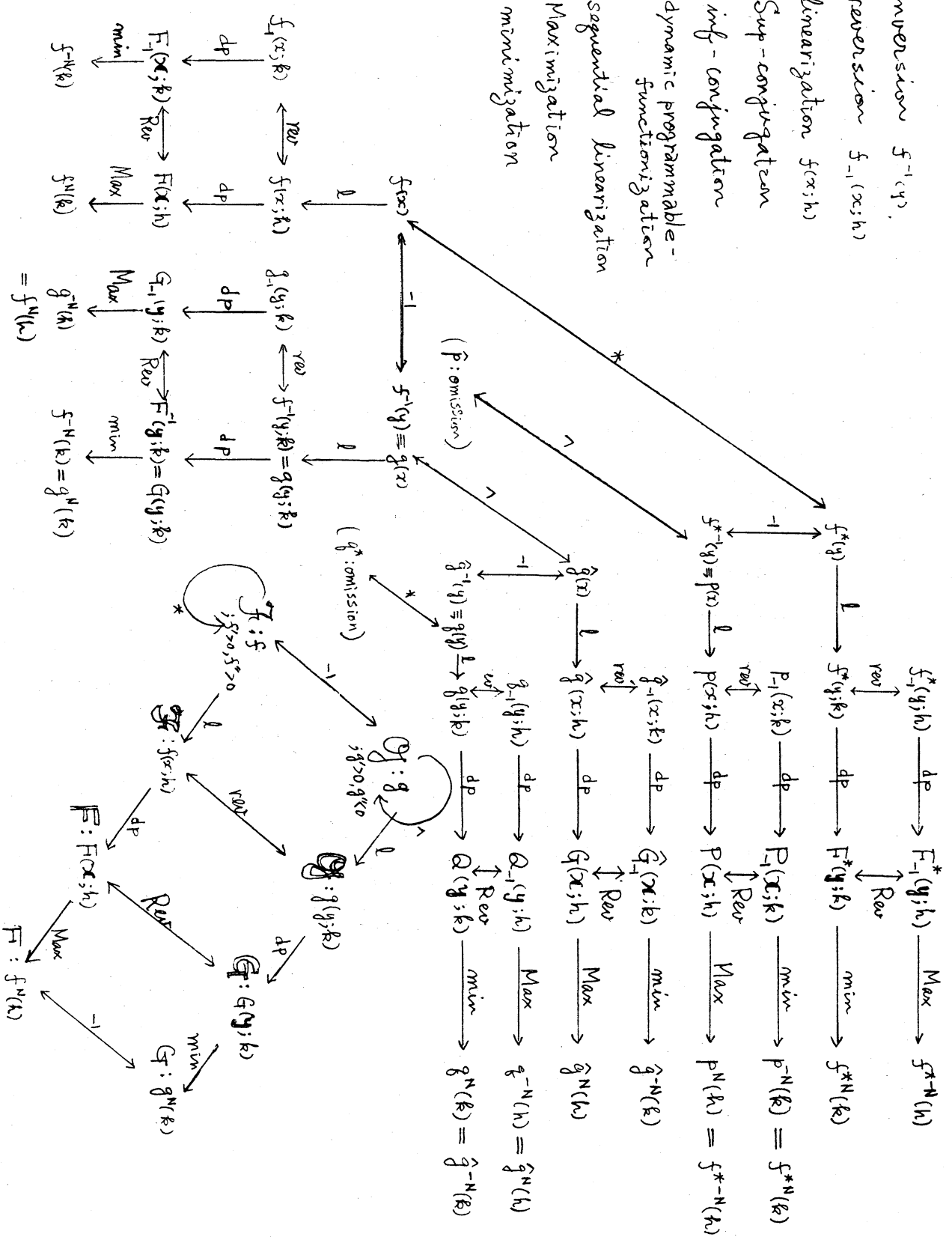
かつ $(x^*, \hat{y}) = (\log l, l)$ は鞍点である。ただし $l > 0$ 。

参考文献

1. R. BELLMAN, "Dynamic Programming," Princeton Univ. Press, N.J., 1957.
2. R. BELLMAN AND R. KALABA, "Quasilinearization and Nonlinear

- Boundary-value Problems," American Elsevier, New York, 1965.
3. R. BELLMAN AND Wm. KARUSH, On a new functional transform in analysis: the maximum transform, Bull. Amer. Math. Soc. **67** (1961), 501-503.
 4. ——— AND ———, Mathematical programming and the maximum transform, J. SIAM. Appl. Math. **10** (1962), 550-567.
 5. ——— AND ———, On the maximum transform and semigroups of transformations, Bull. Amer. Math. Soc. **68** (1962), 516-518.
 6. ——— AND ———, Functional equations in the theory of dynamic programming -XII: an application of the maximum transform, J. Math. Anal. Appl. **6** (1963), 155-157.
 7. ——— AND ———, On the maximum transform, J. Math. Anal. Appl. **6** (1963), 67-74.
 8. N. FURUKAWA AND S. IWAMOTO, Dynamic programming on recursive reward systems, Bull. Math. Statist. **17** (1976), 103-126.
 9. S. IWAMOTO, Some operations on dynamic programming with one-dimensional state space, J. Math. Anal. Appl. **69** (1979), 263-282.
 10. ———, Reverse function, reverse program and reverse theorem in mathematical programming, J. Math. Anal. Appl. **95** (1983), 1-19.
 11. ———, Sequential minimaximization under dynamic programming structure, J. Math. Anal. Appl. **108** (1985), 267-282.
 12. S. IWAMOTO, R. J. TOMKINS AND C.-L. WANG, Some theorems on reverse inequalities, J. Math. Anal. Appl. to appear.
 13. E. Stanley LEE, "Quasilinearization and Invariant Imbedding," Academic Press, New York, 1968.

- 1: inversion $f^{-1}(y)$.
- rev: reversion $f_{-1}(x;h)$
- l: linearization $f(x;h)$
- *: Sup-conjugation
- ∧: inf-conjugation
- dp: dynamic programming - functionalization
- sl: sequential linearization
- Max: Maximization
- min: minimization



Diagrammatic Summary of Sequential Quasilinearization