

Condições Suficientes de Otimalidade em Cálculo das Variações no Contexto Não-Suave

Caroline de Arruda Signorini¹

Valeriano Antunes de Oliveira²

Instituto de Biociências, Letras e Ciências Exatas, UNESP - Univ. Estadual Paulista “Júlio de Mesquita Filho”, Câmpus de São José do Rio Preto, Departamento de Matemática Aplicada.

Resumo. O principal propósito deste trabalho é o estudo de condições suficientes de otimalidade para problemas de Cálculo das Variações no contexto não-suave, caso em que consideramos Lagrangianas não-suaves e soluções absolutamente contínuas. Analisaremos as condições suficientes através de um conceito de convexidade generalizada, o qual denominamos E-pseudoinvexidade.

Palavras-chave. Cálculo das variações, Lagrangianas não-suaves, Condições suficientes de otimalidade, Soluções absolutamente contínuas, Convexidade generalizada.

1 Introdução

Segundo van Brunt [2], o Cálculo Variacional, também conhecido como Cálculo das Variações, tem uma longa história de interação com outras ramificações da Matemática, como a geometria e as equações diferenciais, e da Física, particularmente a mecânica. Recentemente, o Cálculo Variacional vem encontrando aplicações em outros campos, como economia, engenharia e recursos renováveis. Grande parte da matemática subjacente à Teoria do Controle, por exemplo, pode ser considerada parte do Cálculo Variacional.

Ainda que a teoria clássica do Cálculo das Variações tenha origem no século XVII, importantes questões, como as regras de multiplicadores para os problemas com restrições e o teorema de existência de soluções, somente foram elucidadas no século passado, devido ao desenvolvimento nos estudos de Análise Funcional e Cálculo Não-suave.

Neste trabalho, temos por objetivo o estudo de condições suficientes de otimalidade para problemas de Cálculo das Variações no contexto não-suave. Aqui tratamos o problema de Bolza, trabalhando com Lagrangianas não-suaves e um conjunto de condições necessárias de otimalidade envolvendo a inclusão de Euler, o que nos exige o uso de ferramentas da Análise Não-suave.

Sabemos que, geralmente, as condições necessárias de otimalidade para problemas variacionais são suficientes por meio da convexidade dos dados envolvidos, como podemos ver

¹carolineasignorini@gmail.com

²antunes@ibilce.unesp.br

em Clarke [3]. Isso também ocorre quando utilizados certos conceitos convexidade generalizada: em Arana–Jiménez, Osuna–Gómez, Ruiz–Garzón, Rojas–Medar [1], são abordados problemas variacionais com restrições de desigualdade e multiplicadores estão envolvidos na definição; já em Rojas–Jara [5], onde são abordados problemas variacionais com restrições de igualdade, foram obtidas condições suficientes sem a presença dos multiplicadores na definição.

Em Signorini [6], foi introduzida a E-pseudoinvexidade (Euler-pseudoinvexidade): um conceito de convexidade generalizada para problemas variacionais através do qual as condições de transversalidade e a equação/inclusão de Euler tornam-se suficientes para otimalidade global. Tal conceito de convexidade generalizada possui a peculiaridade de ser o mais geral possível, no sentido de que todo problema variacional em que as soluções estacionárias são ótimas necessariamente são E-pseudoinvexos. Aqui apresentaremos o conceito para o caso não-suave.

2 Lagrangianas não-suaves

Abordaremos aqui um contexto não compreendido pela teoria clássica do Cálculo das Variações: o estudo de problemas que envolvem Lagrangianas não-suaves.

2.1 O Problema Lipschitz de Bolza

Consideremos o seguinte problema conhecido como *o Problema de Bolza*:

$$\begin{aligned} \text{minimizar} \quad & J(x) = \ell_0(x(a)) + \ell_1(x(b)) + \int_a^b \Lambda(t, x(t), x'(t)) dt \\ \text{sujeito a} \quad & x \in \text{AC}([a, b]; \mathbb{R}^n), \\ & x(a) \in C_0, \quad x(b) \in C_1, \quad x'(t) \in V(t) \text{ q.t.p.,} \end{aligned} \tag{PLB}$$

onde $\ell_0, \ell_1 : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ são localmente Lipschitz, C_0, C_1 são subconjuntos fechados de \mathbb{R}^n e a multifunção $V : [a, b] \rightsquigarrow \mathbb{R}^n$ é mensurável a conjuntos fechados e convexos de \mathbb{R}^n .

Ressaltamos que, a seguir, as notações $\partial_P \Lambda$ e $\partial_L \Lambda$ se referem aos subdiferenciais proximal e limite, respectivamente, da função $\Lambda(t, x, v)$ tomados com respeito às variáveis (x, v) . E, dados um conjunto $S \subset \mathbb{R}^n$ e um ponto $x \in S$, as notações $T_S(x)$, $N_S(x)$, $T_S^C(x)$ e $N_S^L(x)$ se referem aos cones tangente (de Bouligand), normal, tangente generalizado e normal limite, respectivamente, a S em x . Para mais detalhes das notações acima, ver Clarke [3], pp. 145 e 232 para os subdiferenciais e pp. 20, 21, 212 e 244 para os cones.

Definição 2.1. Um arco (função absolutamente contínua) x é dito ser **admissível** para o problema (PLB) se satisfaz as restrições do problema e se a integral em $J(x)$ é bem definida e finita.

Dizemos que uma função admissível x_* fornece um **mínimo global** para o problema se $J(x_*) \leq J(x)$ para todo x admissível.

Um arco admissível x_* fornece um **mínimo local fraco** se, para algum $\varepsilon > 0$, tem-se $J(x_*) \leq J(x)$ para todo arco admissível x satisfazendo $\|x - x_*\|_\infty \leq \varepsilon$ e $\|x' - x_*'\|_\infty \leq \varepsilon$.

E dizemos que um arco admissível x_* fornece um **mínimo local forte** se existe $\varepsilon > 0$ tal que $J(x_*) \leq J(x)$ para todo arco admissível x que satisfaz $\|x - x_*\|_\infty \leq \varepsilon$.

O seguinte resultado fornece, sob certas circunstâncias, condições necessárias para que um arco admissível seja um mínimo local forte para (PLB).

Teorema 2.1. *Seja x_* um arco admissível e mínimo local forte para (PLB). Supomos que a Lagrangiana $\Lambda : [a, b] \times \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ é mensurável em relação a t e Lipschitz com respeito a (x, v) próximo a x_* no seguinte sentido: existe uma função integrável $k : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ tal que, para quase todo t , para todo $x, y \in B(x_*(t), \varepsilon)$ e $v, w \in V(t)$, seja válida a Hipótese Lipschitz*

$$|\Lambda(t, x, v) - \Lambda(t, y, w)| \leq k(t) (\|x - y\| + \|v - w\|). \tag{HL}$$

Exigimos também a Hipótese de Interioridade: existe uma constante positiva δ tal que

$$B(x'_*(t), \delta) \subset V(t) \text{ q.t.p.}$$

Sob essas condições, existe um arco p satisfazendo a **inclusão de Euler**:

$$p'(t) \in \text{co} \{ \omega : (\omega, p(t)) \in \partial_L \Lambda(t, x_*(t), x'_*(t)) \} \quad t \in [a, b] \text{ q.t.p.}, \tag{E}$$

juntamente com a **condição de Weierstrass**: para quase todo t ,

$$\Lambda(t, x_*(t), v) - \Lambda(t, x_*(t), x'_*(t)) \geq \langle p(t), v - x'_*(t) \rangle \quad \forall v \in V(t) \tag{W}$$

e as **condições de transversalidade e de fronteira**:

$$\begin{cases} p(a) \in \partial_L \ell_0(x_*(a)) + N_{C_0}^L(x_*(a)) \\ -p(b) \in \partial_L \ell_1(x_*(b)) + N_{C_1}^L(x_*(b)). \end{cases} \tag{T}$$

(Demonstração em Clarke [3], Teorema 18.1, pp. 348, 354-360)

Observe que a Hipótese Lipschitz (HL) vale se V é uniformemente limitada e Λ é localmente Lipschitz. Assim, o teorema acima se aplica, em particular, para um **mínimo local fraco** x_* na classe $\text{Lip}[a, b]$ e para Lagrangiana localmente Lipschitz, tomando $V(t)$ da forma $B(x'_*(t), \delta)$. Desta maneira, a Hipótese de Interioridade vale automaticamente.

Note também que a diferenciabilidade de Λ não é assumida. Como sabemos, quando Λ é continuamente diferenciável em (x, v) , o conjunto $\partial_L \Lambda$ é composto unicamente pelo gradiente. Nesse caso, (E) é equivalente à forma integral da equação de Euler expressa em termos da variável de coestado p , isto é,

$$p'(t) = \nabla_x \Lambda(t, x_*(t), x'_*(t)), \quad p(t) = \nabla_v \Lambda(t, x_*(t), x'_*(t)).$$

Exemplo 2.1. O seguinte problema ilustra a utilidade de enfraquecer as hipóteses de regularidade sobre a Lagrangiana:

$$\begin{aligned} &\text{minimizar} && \int_0^2 \vartheta(t) \sqrt{1 + x'(t)^2} dt \\ &\text{sujeito a} && x(0) = 0, \quad x(2) = 2, \end{aligned}$$

onde

$$\vartheta(t) = \begin{cases} v_0^{-1} & \text{se } t < 1 \\ v_1^{-1} & \text{se } t > 1. \end{cases}$$

Note que, neste caso, a Lagrangiana é descontínua porém mensurável na variável t .

2.2 Condições suficientes por E-pseudoinvexidade no contexto não-suave

Nesta seção, trataremos o conceito de problema E-pseudoinvexo, introduzido por Signorini [6], para o cenário não-suave dos problemas variacionais. Veremos que a inclusão de Euler e a condição de transversalidade do Teorema 2.1 tornam-se condições suficientes para otimalidade global sob hipóteses de E-pseudoinvexidade (Euler-pseudoinvexidade).

Definição 2.2. Dizemos que $x : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^n$ é uma **função estacionária** para o problema (PLB) se x é admissível para (PLB) e se existe um arco $p : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^n$ para o qual as condições (E) e (T) do Teorema 2.1 são satisfeitas.

Definição 2.3. Dizemos que o problema (PLB) é **E-pseudoinvexo** se, para cada par x, y de arcos admissíveis tais que $J(y) < J(x)$ e para cada tripla $(\zeta, \alpha_0, \alpha_1) \in \text{AC}[a, b] \times \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^n$ com

$$\zeta'(t) \in \text{co}\{\omega : (\omega, \zeta(t)) \in \partial_L \Lambda(t, x(t), x'(t))\}, \quad t \in [a, b] \text{ q.t.p.}, \quad (1)$$

e

$$(\alpha_0, \alpha_1) \in \partial_L \ell_0(x(a)) \times \partial_L \ell_1(x(b)), \quad (2)$$

existe um arco $\gamma = \gamma(x, y, \zeta, \alpha_0, \alpha_1) : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^n$ satisfazendo

$$\gamma(a) \in T_{C_0}^C(x(a)), \quad \gamma(b) \in T_{C_1}^C(x(b)), \quad (3)$$

e

$$\int_a^b [\zeta'(t)^T \gamma(t) + \zeta(t)^T \gamma'(t)] dt + \gamma(a)^T \alpha_0 + \gamma(b)^T \alpha_1 < 0. \quad (4)$$

Note que a Definição 2.3 estende para o contexto de Cálculo das Variações o conceito de pseudoinvexidade em Programação Matemática apresentado por Hanson em [4].

O próximo resultado estabelece a E-pseudoinvexidade como condição suficiente para que uma função estacionária para (PLB) seja um mínimo global do problema.

Teorema 2.2. Se (PLB) é E-pseudoinvexo, então toda função estacionária x é um mínimo global.

Demonstração: Suponha que x seja uma função estacionária não-ótima para (PLB). Então existe um arco y admissível para (PLB) tal que $J(y) < J(x)$. Como x é uma função estacionária, existe uma aplicação $p \in \text{AC}[a, b]$ satisfazendo as condições (E) e (T) do Teorema 2.1. Deste modo, existem $\alpha_0 \in \partial_L \ell_0(x(a))$, $\nu_0 \in N_{C_0}^L(x(a))$, $\alpha_1 \in \partial_L \ell_1(x(b))$ e $\nu_1 \in N_{C_1}^L(x(b))$ tais que $p(a) = \alpha_0 + \nu_0$ e $-p(b) = \alpha_1 + \nu_1$. Assim, pela hipótese de E-pseudoinvexidade, existe um arco $\gamma = \gamma(x, y, p, \alpha_0, \alpha_1) : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^n$ satisfazendo

as condições (3) – (4). Usando o Teorema fundamental do Cálculo, a condição (3) e a definição de ν_0 e ν_1 , temos

$$0 > \int_a^b [p'(t)^T \gamma(t) + p(t)^T \gamma'(t)] dt + \gamma(a)^T \alpha_0 + \gamma(b)^T \alpha_1 = -\gamma(a)^T \nu_0 - \gamma(b)^T \nu_1 \geq 0,$$

uma contradição. Portanto, x é mínimo global. ■

O teorema abaixo estabelece como condição necessária a E-pseudoinvexidade para que toda função estacionária seja um mínimo global do problema (PLB).

Teorema 2.3. *Se toda função estacionária de (PLB) é um mínimo global, então o problema (PLB) é E-pseudoinvexo.*

Demonstração: Negando a definição de E-pseudoinvexidade, obtemos a existência de um par x, y de arcos admissíveis com $J(y) < J(x)$ e de uma tripla $(\zeta, \alpha_0, \alpha_1)$ em $AC[a, b] \times \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^n$ satisfazendo (1) – (2) de modo que, para todo arco $\gamma : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^n$ que cumpra (3), a desigualdade (4) não é válida.

Agora, como $\gamma_* \equiv 0$ é um mínimo global para o problema auxiliar

$$\begin{aligned} \text{minimizar} \quad & F(\gamma) = \alpha_0^T \gamma(a) + \alpha_1^T \gamma(b) + \int_a^b [\zeta'(t)^T \gamma(t) + \zeta(t)^T \gamma'(t)] dt \\ \text{sujeito a} \quad & \gamma \in AC([a, b]; \mathbb{R}^n), \\ & \gamma(a) \in T_{C_0}^C(x(a)), \quad \gamma(b) \in T_{C_1}^C(x(b)), \quad \gamma'(t) \in \mathbb{R}^n \text{ q.t.p.,} \end{aligned}$$

podemos aplicar o Teorema 2.1, obtendo a existência de um arco $p : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^n$ tal que

$$\begin{aligned} p'(t) &\in \text{co} \{ \omega : (\omega, p(t)) \in \partial_L f(t, \gamma_*(t), \gamma'_*(t)) \} = \{ (\zeta'(t), \zeta(t)) \}, \quad t \in [a, b] \text{ q.t.p.,} \\ p(a) &\in \partial_L h_0(\gamma_*(a)) + N_{T_{C_0}^L(x(a))}^L(\gamma_*(a)) = \{ \alpha_0 \} + N_{C_0}^L(x(a)) \\ -p(b) &\in \partial_L h_1(\gamma_*(b)) + N_{T_{C_1}^L(x(b))}^L(\gamma_*(b)) = \{ \alpha_1 \} + N_{C_1}^L(x(b)). \end{aligned}$$

Sendo assim, p satisfaz a inclusão de Euler e a condição de transversalidade para o arco admissível x no problema original, de modo que x é uma função estacionária. Logo, por hipótese, x é um mínimo global, o que contradiz a desigualdade $J(y) < J(x)$. Concluimos, assim, que o problema (PLB) é E-pseudoinvexo. ■

Exemplo 2.2. A fim de ilustrar os resultados acima, temos o seguinte Problema de Bolza:

$$\begin{aligned} \text{minimizar} \quad & J(x) = 2x(0) + x(2) + \int_0^2 [1 - |x(t) - 1| + 2x(t) + 3tx'(t)] dt \\ \text{sujeito a} \quad & x \in AC([0, 2]; \mathbb{R}), \\ & x(0) \in [0, 2], \quad x(2) \in [0, 3], \quad x'(t) \in [0, 3t + 2] \text{ q.t.p.} \end{aligned}$$

Note, neste caso, que $\Lambda(t, x, v)$ não é diferenciável nem convexa em x e também que $x(t) \geq 0$ para todo x admissível.

Supondo que x_* seja uma função estacionária, existe um arco $p : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ satisfazendo a inclusão de Euler $p'(t) \in \text{co}\left\{\omega : (\omega, p(t)) \in \partial_L \Lambda(t, x_*(t), x'_*(t))\right\}$ q.t.p., onde

$$\partial_L \Lambda(t, x_*(t), x'_*(t)) = \begin{cases} \{3\} & \times \{3t\} & \text{se } 0 \leq x_*(t) < 1, \\ \{1\} \cup \{3\} & \times \{3t\} & \text{se } x_*(t) = 1, \\ \{1\} & \times \{3t\} & \text{se } x_*(t) > 1. \end{cases}$$

Assim, $p(t) = 3t$ para $0 \leq t \leq 2$, de modo que $p'(t) = 3$. Além disso, p satisfaz as condições de transversalidade e de fronteira

$$p(0) \in \partial_L \ell_0(x_*(0)) + N_{C_0}^L(x_*(0)) = \begin{cases} (-\infty, 2] & \text{se } x_*(0) = 0, \\ \{2\} & \text{se } x_*(0) \in (0, 2), \\ [2, +\infty) & \text{se } x_*(0) = 2, \end{cases}$$

e

$$-p(2) \in \partial_L \ell_1(x_*(2)) + N_{C_1}^L(x_*(2)) = \begin{cases} (-\infty, 1] & \text{se } x_*(2) = 0, \\ \{1\} & \text{se } x_*(2) \in (0, 3), \\ [1, +\infty) & \text{se } x_*(2) = 3. \end{cases}$$

Como $p(0) = 0$ e $-p(2) = -6$, segue que $x_*(0) = x_*(2) = 0$. Veja que, pela admissibilidade de x_* , temos $x'_*(t) \in [0, 3t+2]$, isto é, $x'_*(t) \geq 0$ para todo $t \in [0, 2]$. Visto que $x_* \in \text{AC}[0, 2]$, segue que há somente uma função estacionária para este problema: $x_* \equiv 0$. Como x_* é mínimo global, pelo Teorema 2.3, este problema deve ser E-pseudoinvexo.

De fato, considerando funções admissíveis x, y com $J(y) < J(x)$ e uma tripla $(\zeta, \alpha_0, \alpha_1)$ satisfazendo (1) – (2), basta tomar a aplicação absolutamente contínua $\gamma : [0, 2] \rightarrow \mathbb{R}^n$ definida por $\gamma(t) = -\alpha_0 \zeta(t)$.

Observação 2.1. A E-pseudoinvexidade é um tipo de convexidade generalizada, isto é, todo problema convexo é também E-pseudoinvexo. De fato, considere o problema

$$\begin{aligned} \text{minimizar} \quad & J(x) = \ell_0(x(a)) + \ell_1(x(b)) + \int_a^b \Lambda(t, x(t), x'(t)) dt \\ \text{sujeito a} \quad & x \in \text{AC}([a, b]; \mathbb{R}^n), \\ & x(a) \in C_0, \quad x(b) \in C_1, \quad x'(t) \in V(t) \quad \text{q.t.p.} \end{aligned}$$

Além das hipóteses iniciais, suponha que as funções $\ell_0, \ell_1 : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ e os conjuntos $C_0, C_1 \subset \mathbb{R}^n$ são convexos. Suponha também que a Lagrangiana $\Lambda(t, x, v)$ é convexa em (x, v) . Assim, os subdiferenciais limite de ℓ_0, ℓ_1 e Λ em qualquer ponto coincidem com o subdiferencial da Análise Convexa neste mesmo ponto. Agora, sejam x, y arcos admissíveis com $J(y) < J(x)$ e a tripla $(\zeta, \alpha_0, \alpha_1) \in \text{AC}[a, b] \times \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^n$ de modo que as condições (1) – (2) sejam satisfeitas. Podemos tomar a aplicação absolutamente contínua $\gamma = \gamma(x, y, \zeta, \alpha_0, \alpha_1) : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}^n$ dada por $\gamma(t) = [y(t) - x(t)]$, obtendo

$$\gamma(a) \in T_{C_0}^C(x(a)) = T_{C_0}(x(a)), \quad \gamma(b) \in T_{C_1}^C(x(b)) = T_{C_1}(x(b)),$$

e

$$\begin{aligned} & \int_a^b \left[\zeta'(t)^T \gamma(t) + \zeta(t)^T \gamma'(t) \right] dt + \gamma(a)^T \alpha_0 + \gamma(b)^T \alpha_1 \\ & \leq \int_a^b \left[\Lambda(t, y(t), y'(t)) - \Lambda(t, x(t), x'(t)) \right] dt + \ell_0(y(a)) - \ell_0(x(a)) + \ell_1(y(b)) - \ell_1(x(b)) \\ & = J(y) - J(x) < 0. \end{aligned}$$

3 Conclusões

O interesse no estudo de problemas variacionais não-suaves decorre da abordagem de um contexto mais geral (e complexo) do que aqueles estudados em textos mais comuns de Cálculo das Variações, o caso suave.

Outro tópico de destaque no presente trabalho é a introdução da E-pseudoinvexidade, conceito de convexidade generalizada para problemas variacionais, por meio do qual as condições de transversalidade e de fronteira e a inclusão de Euler são suficientes para otimalidade global.

Agradecimentos

À FAPESP por meio dos processos 2014/24271-6, 2013/07375-0 (CEPID) e 2016/03540-4.

Ao CNPq por meio dos processos 310955/2015-7 e 457785/2014-4.

Referências

- [1] M. Arana-Jiménez and R. Osuna-Gómez and G. Ruiz-Garzón and M. Rojas-Medar. On variational problems: Characterization of solutions and duality, *J. Math. Anal. Appl.*, volume 311, pp. 1–12, 2005. DOI: 10.1016/j.jmaa.2004.12.001.
- [2] B. van Brunt. *The Calculus of Variations*. Springer-Verlag New York, Inc., 2004.
- [3] F. Clarke. *Functional Analysis, Calculus of Variations and Optimal Control*. Springer, London, 2013.
- [4] M. A. Hanson. On sufficiency of the Kuhn-Tucker conditions, *J. Math. Anal. Appl.*, volume 80, pp. 545–550, 1981. DOI: 10.1016/0022-247X(81)90123-2.
- [5] R. Rojas-Jara. Condições Suficientes de Otimalidade em Cálculo Variacional. Dissertação de Mestrado, UNESP - Câmpus de S. J. do Rio Preto, 2013.
- [6] C. A. Signorini. Condições de Otimalidade em Cálculo das Variações no Contexto Não-Suave. Dissertação de Mestrado, UNESP - Câmpus de S. J. do Rio Preto, 2017.