

ЧИСЛЕННОЕ ВЫЧИСЛЕНИЕ МЕРЫ НЕВЫПУКЛОСТИ α -МНОЖЕСТВ В ВИДЕ МНОГОУГОЛЬНИКОВ И МНОГОГРАННИКОВ

Д.Б. Давлетов, А.А. Ершов, В.Н. Ушаков

МЕЖДУНАРОДНАЯ КОНФЕРЕНЦИЯ
«ТЕОРИЯ ФУНКЦИЙ И ЕЕ ПРИЛОЖЕНИЯ»,
ПОСВЯЩЕННАЯ 120-ЛЕТИЮ СО ДНЯ РОЖДЕНИЯ
АКАДЕМИКА РАН СЕРГЕЯ МИХАЙЛОВИЧА НИКОЛЬСКОГО

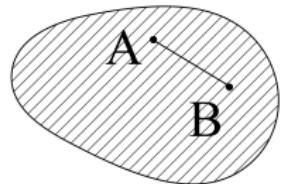
Московская область, г. Долгопрудный, МФТИ
1 — 5 июля 2025 г.

Раздел 1: определение и основные свойства α -множеств

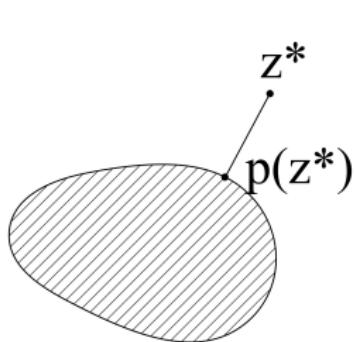
3. История развития теории α -множеств

1. Ушаков В.Н., Успенский А.А., Фомин А.Н. α -множества и их свойства / ИММ УрО РАН. Екатеринбург, 2004. 62 с. Деп. в ВИНИТИ 02.04.2004, № 543-В2004.
2. Ушаков В.Н., Успенский А.А. α -множества в конечномерных евклидовых пространствах и их свойства // Вестн. Удмуртск. ун-та. Матем. Мех. Компьют. науки. 2016. Т. 26, вып. 1. С. 95–120.
3. Ушаков В.Н., Успенский А.А. Теоремы об отделимости α -множеств в евклидовом пространстве // Труды ИММ. 2016. Т. 22, № 2. С. 277–291.

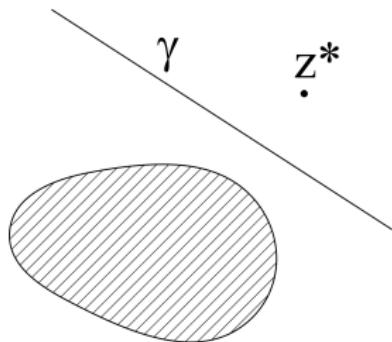
4. Определение и критерии выпуклых множеств



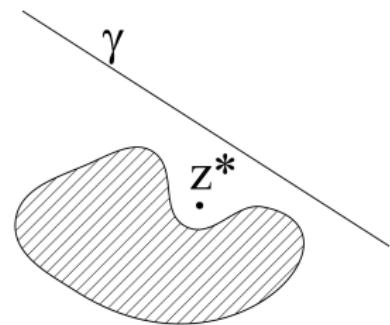
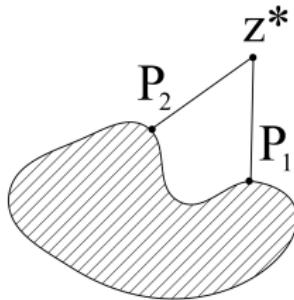
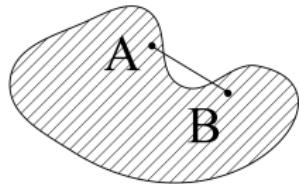
Определение



Теорема Каратеодори



Теорема об отделимости



5. Определение α -множества

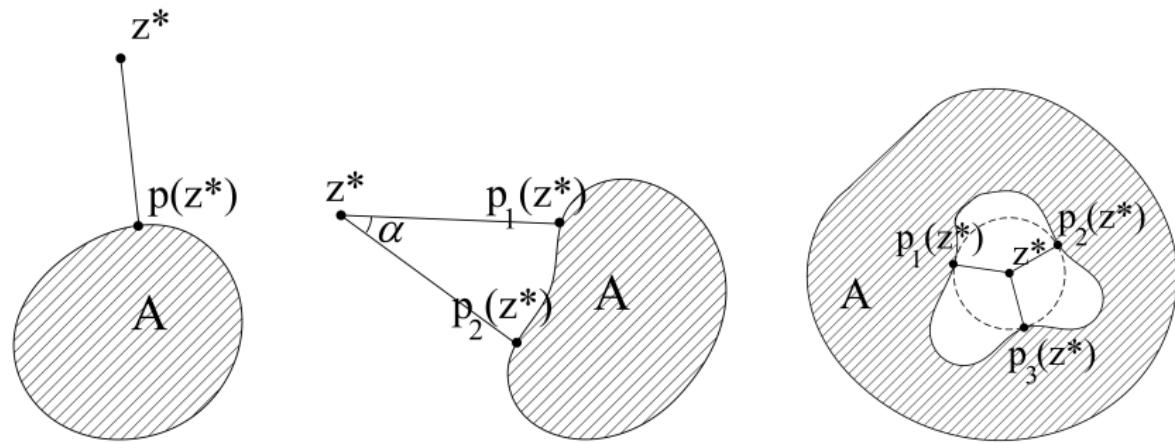


Рис. 2. Выпуклое множество (0-множество), α -множество и π -множество.

6. Определение α -множества

Для замкнутого множества $M \subset \mathbb{R}^n$ обозначим:

$\Omega_M(z^*)$ — множество всех метрических проекций $p(z^*)$ точки z^* на M ;

$\text{co}\Omega_M(z^*)$ — выпуклая оболочка множества $\Omega_M(z^*)$;

$\text{con}(\text{co}\Omega_M(z^*) - z^*) = \{h = \lambda(z - z^*) : \lambda \geq 0, z \in \text{co}\Omega_M(z^*)\}$ — конус в \mathbb{R}^n , натянутый на множество $\text{co}\Omega_M(z^*) - z^* = \{z - z^* : z \in \text{co}\Omega_M(z^*)\}$;

$H_M(z^*)$ — множество всевозможных пар (h_*, h^*) ненулевых векторов h_* и h^* из $\text{con}(\text{co}\Omega_M(z^*) - z^*)$;

$\angle(h_*, h^*) = \arccos \frac{\langle h_*, h^* \rangle}{\|h_*\| \cdot \|h^*\|} \in [0, \pi]$ — угол между векторами h_* и h^* ;

$\alpha_M(z^*) = \max_{(h_*, h^*) \in H_M(z^*)} \angle(h_*, h^*) \in [0, \pi]$;

$\alpha_M = \sup_{z^* \in \mathbb{R}^n \setminus M} \alpha_M(z^*) \in [0, \pi]$.

Определение 1 [1, 2]. Пусть $M \subset \mathbb{R}^n$ — замкнутое множество и $\alpha_M = \alpha$. Тогда множество M назовём α -множеством.

7. Основные свойства α -множеств

1) α -множество — односвязно (при $\alpha < \pi$)

2) $\alpha_A \geqslant \alpha_{A_\varepsilon}$, где A_ε — ε -окрестность множества A .

Если A — компакт, то $\alpha_{A_\varepsilon} \downarrow 0$ при $\varepsilon \rightarrow +\infty$.

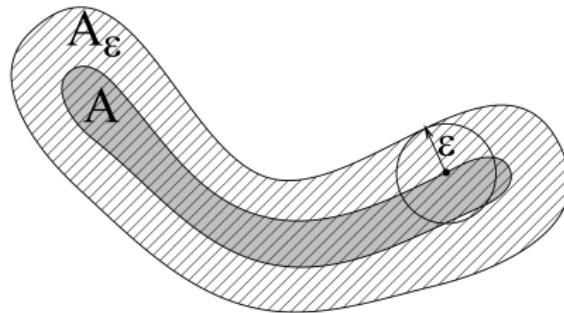


Рис. 3.

3) α -отделимость

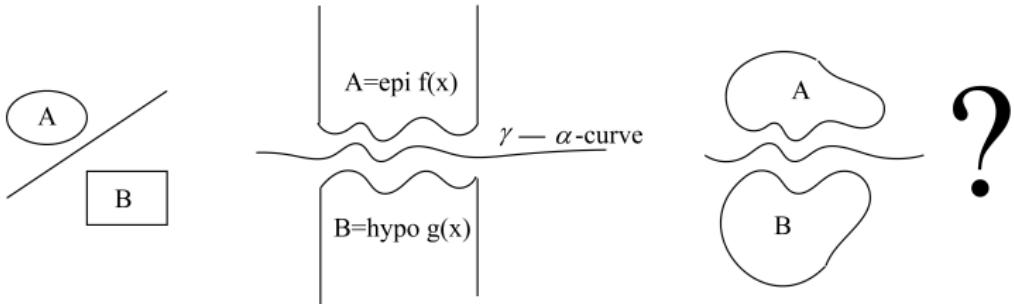


Рис. 4.

4) Пусть $M \subset \mathbb{R}^2$ — α -множество с границей в виде кривой конечной длины. Тогда $d(M, \text{co}M) = \max\{h(M, \text{co}M), h(\text{co}M, M)\} = \max_{x \in \text{co}M} \rho(x, M) \leq \lambda(M) \operatorname{tg} \frac{\alpha}{2}$.

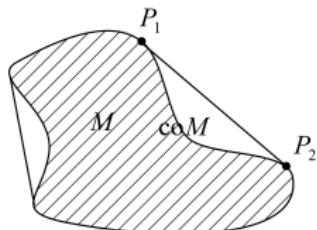


Рис. 5. Множество M и его выпуклая оболочка со M .

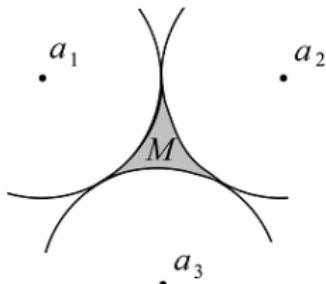
Раздел 2: взаимосвязь с другими обобщениями выпуклых множеств

10. Слабо выпуклые множества по Ефимову-Стечкину

Определение 5 [6, 7]. Множество M в метрическом пространстве X называется слабо выпуклым по Ефимову-Стечкину с постоянной $R > 0$, если существует непустое множество $A \subset X$ такое, что

$$M = \bigcap_{a \in A} (B(a, R))^c = \bigcap_{a \in A} (X \setminus B(a, R)),$$

где $B(a, R) = \{x \in X : \rho(x, a) < R\}$ — открытый шар радиуса R и с центром в точке a .



Применение:
непрерывные
селекторы
многозначных
отображений.

Рис. 6. Пример слабо выпуклого множества.

11. Множества, слабо выпуклые по Виалю

Определение 6 [7]. Пусть в метрическом пространстве X заданы две точки x_1, x_2 , и задано число $R \geqslant \frac{\rho(x_1, x_2)}{2}$.

Множество

$$D_R(x_1, x_2) = \bigcap_{a \in X : \{x_1, x_2\} \subset B(a, R)} B(a, R)$$

называется *сильно выпуклым отрезком*.

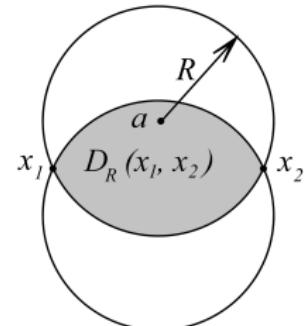


Рис. 7. Сильно выпуклый отрезок.

Определение 7 [7]. Множество M в метрическом пространстве X называется *слабо выпукло по Виалю с постоянной R* , если для любых двух точек $x_1, x_2 \in M$ таких, что $0 < \rho(x_1, x_2) < 2R$, справедливо соотношение

$$M \cap D_R^o(x_1, x_2) = M \cap (D_R(x_1, x_2) \setminus \{x_1, x_2\}) \neq \emptyset.$$

12. Взаимосвязь α -множеств со слабо выпуклыми множествами

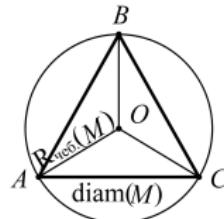
Теорема 2 [8]. Пусть связное множество M в \mathbb{R}^2 слабо выпукло по Ефимову-Стечкину с постоянной $R > \frac{1}{2}\text{diam}(M)$. Тогда M есть α -множество с числом

$$\alpha \leqslant 2 \arcsin \frac{\text{diam}(M)}{2R}. \quad (1)$$

Теорема 3 [9]. Пусть замкнутое множество M в \mathbb{R}^n слабо выпукло по Виалю с постоянной R , и пусть чебышевский радиус $R_{\text{чеб.}}(M) < R$. Тогда множество M является α -множеством с числом

$$\alpha \leqslant 2 \arcsin \frac{R_{\text{чеб.}}(M)}{R}. \quad (2)$$

$$\boxed{\frac{1}{2}\text{diam}(M) \leqslant R_{\text{чеб.}}(M)}$$



$$\text{diam}(M) = 1, \\ R_{\text{чеб.}}(M) = \sqrt{3}/3$$

13. Усиление оценки (4)

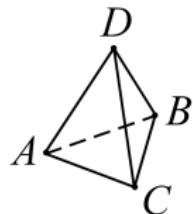


Рис. 8. $\text{diam}(M) = 1$,
 $R_{\text{чеб.}}(M) = \frac{\sqrt{6}}{4}$

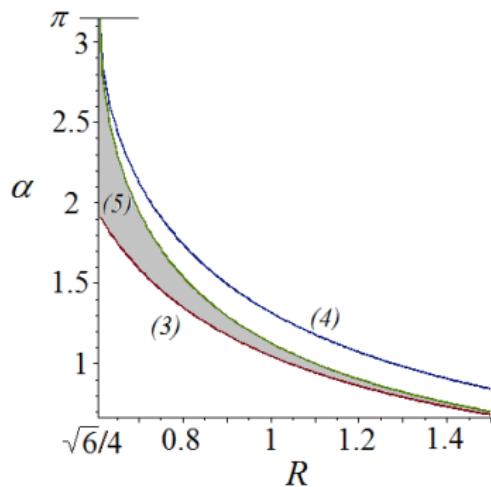


Рис. 9. Усиление оценки.

Теорема 4 [10]. Пусть замкнутое множество A в \mathbb{R}^n слабо выпукло по Виалю с постоянной $R \geqslant R_{\text{чеб.}}(A)$. Тогда множество A является α -множеством с числом

$$\alpha \leqslant 2 \arcsin \frac{\text{diam}(A)}{2 \sqrt{R^2 - R_{\text{чеб.}}^2(A) + \frac{1}{4} \text{diam}^2(A)}}. \quad (3)$$

14. Коэффициент вогнутости Морделла

Определение 8 [11]. Пусть S — звездная центрально-симметричная относительно начала координат фигура на плоскости. Тогда коэффициентом вогнутости Морделла называется следующая величина:

$$\omega_S = \inf \left\{ \omega : \frac{x+y}{2} \in \omega \cdot S \text{ для любых } x, y \in S \right\} \in [1, +\infty).$$

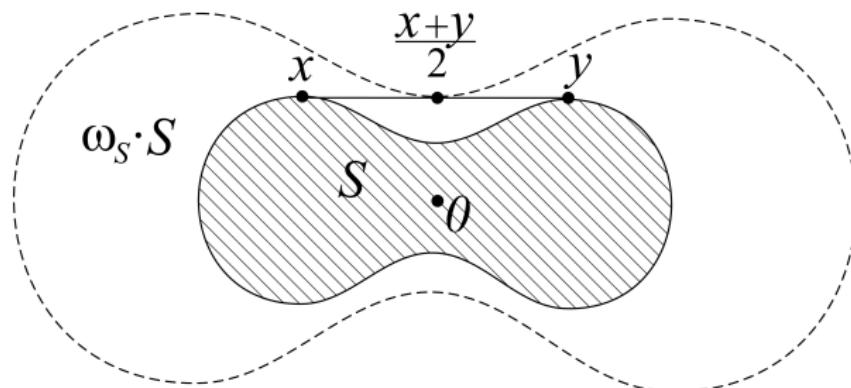


Рис. 10.

Применение: геометрия чисел.

15. Соотношение между α -множествами и множествами, имеющими конечный коэффициент вогнутости Морделла

Теорема 5 [11]. Пусть S — звёздная центрально-симметричная фигура на плоскости. Тогда выполняется неравенство

$$\omega_S \leq \frac{m_S}{m_S - 2r(S)\operatorname{tg}\frac{\alpha_S}{2}},$$

где $m_S = \min_{x \in \partial S} \|x\|$ — радиус наибольшего круга с центром в начале координат, который целиком помещается в S ,

$R(T) = \inf\{R : T \subset B(z, R) \text{ для некоторого } z \in \mathbb{R}^2\}$ — чебышевский радиус множества T , т.е. радиус наименьшего круга, содержащего T ,

$r(S) = \sup_{x \in \operatorname{co} M} \inf_{\substack{T: T \subset M, \\ x \in \operatorname{co} T}} R(T)$ — внутренний радиус множества S .

16. $\hat{\alpha}$ -Паравыпуклые множества Э. Майкла

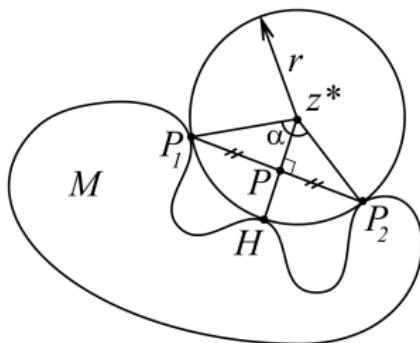
Определение 9 [7]. Множество называется $\hat{\alpha}$ -паравыпуклым множеством, если имеет место равенство

$$\hat{\alpha} = \sup_{z \in \mathbb{R}^n, r > 0, M \cap B(z, r) \neq \emptyset} \frac{h(\text{co}(M \cap B(z, r)), M \cap B(z, r))}{r} \in [0, 1].$$

Здесь $B(z, r)$ — шар радиуса r с центром в точке z ,

со A — выпуклая оболочка множества A („наименьшее“ выпуклое множество, содержащее A),

$\rho(A, B) = \max_{x \in A} \rho(x, B)$ — хаусдорфово отклонение множества A от B .



$$M \cap B(z^*, r) = \{P_1, P_2, H\}, \quad r = |z^*H|,$$

$$\begin{aligned} h(\text{co}(M \cap B(z^*, r)), M) &= \rho(P, M) = |\rho H| \\ &= r - |z^*P| = r - r \cos \frac{\alpha}{2} \Rightarrow \hat{\alpha} \geq 1 - \cos \frac{\alpha}{2} \end{aligned}$$

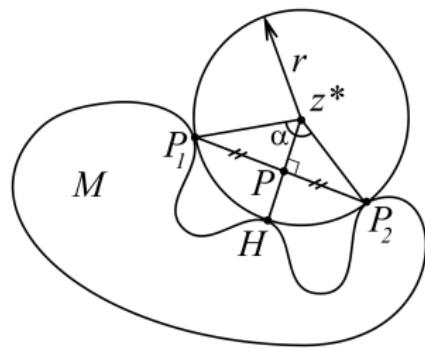
Применение: непрерывная селекция отображений.

17. Соотношение между α -множествами и $\hat{\alpha}$ -параравыпуклыми множествами Э. Майкла

Теорема 6 [12]. Если рассматривать α -множество как $\hat{\alpha}$ -параравыпуклое множество, то

$$1 - \cos \frac{\alpha}{2} \leq \hat{\alpha}.$$

Доказательство:



$$\hat{\alpha} = \sup_{\substack{z \in \mathbb{R}^n, r > 0: \\ M \cap B(z, r) \neq \emptyset}} \frac{h(\text{co}(M \cap B(z, r)), M)}{r}$$

Рис. 11.

Гипотеза 4. $\hat{\alpha} \leq \sin \frac{\alpha}{2}$?

18. Соотношение между α -множествами и $\hat{\alpha}$ -паравыпуклыми множествами Э. Майкла

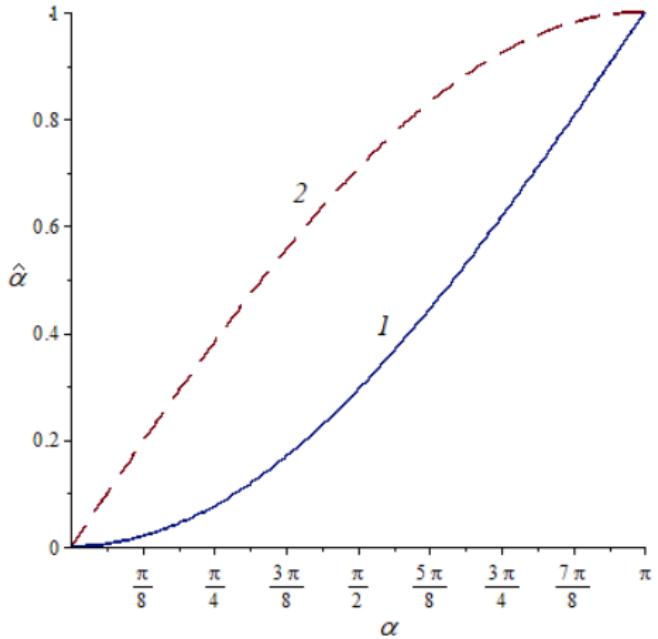


Рис. 12. Нижняя и верхняя оценки для меры невыпуклости $\hat{\alpha}$.
1 — график функции $y = 1 - \cos \frac{\alpha}{2}$, 2 — график функций $y = \sin \frac{\alpha}{2}$.

Раздел 3: применение α -множеств в теории управления

20. Геометрия множеств достижимости

Допустим сначала, что система Σ имеет на промежутке $[t_0, T]$ вид

$$\frac{dx}{dt} = A(t)x + B(t)u, \quad (4)$$

$x(t_0) \in X^{(0)}$ и $u \in P$, где $X^{(0)}$ и P — выпуклые компакты в \mathbb{R}^n и \mathbb{R}^p .

- Множества достижимости $X(t, t_0, X^{(0)})$ системы (4) имеют «хорошую» геометрическую структуру: от начального множества $X^{(0)}$ они наследуют свойство выпуклости.

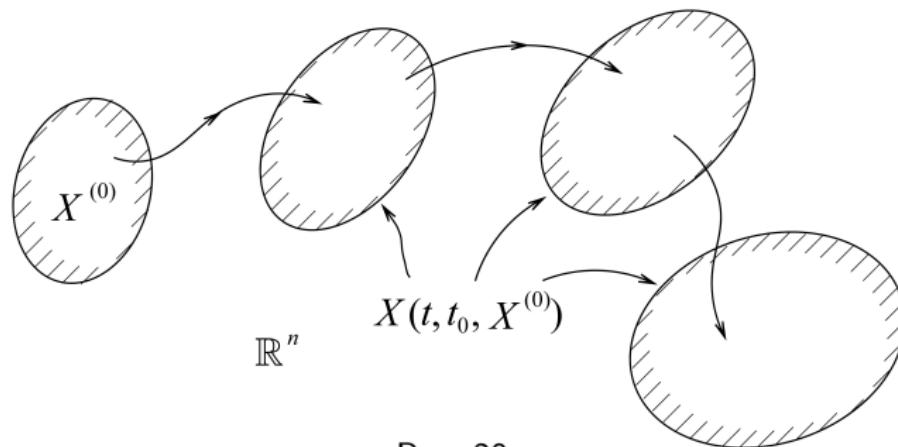


Рис. 20

21. Геометрия множеств достижимости

- Наличие такой «хорошей» геометрии у множеств достижимости $X(t, t_0, X^{(0)}), t \in [t_0, T]$ облегчает построение разрешающих конструкций в задачах управления, поскольку эти множества для всех точек y , лежащих вне их, обладают единственной проекцией $p(y)$.

Усложним несколько систему (4), а именно, рассмотрим управляемую систему

$$\frac{dx}{dt} = f(t, x) + B(t)u, \quad (5)$$

$x(t_0) \in X^{(0)}$ и $u \in P$, где $X^{(0)}$ и P — выпуклые компакты в \mathbb{R}^2 , $f(t, x)$ — нелинейная вектор-функция по t, x .

- У системы (5) при условии выпуклости множества $X^{(0)}$ множества достижимости $X(t, t_0, X^{(0)}), t \in [t_0, T]$ уже не наследуют выпуклость компакта $X^{(0)}$, что существенно усложняет построение разрешающих управлений.

22. Геометрия множеств достижимости

- Возникает естественный вопрос:

«Пусть начальное множество $X^{(0)}$ для системы Σ в \mathbb{R}^n выпукло или по своей геометрии близко к выпуклому множеству. Как меняется степень невыпуклости множества $X(t, t_0, X^{(0)})$ с изменением t на промежутке $[t_0, T]$?»

- Более конкретно этот вопрос можно сформулировать так:

«Можно ли оценить сверху величину $\alpha_{X(t)}$ с изменением времени t на промежутке $[t_0, T]$?»

Здесь $X(t) = X(t, t_0, X^{(0)}), t \in [t_0, T]$.

Обсуждению этого вопроса предпошлём ещё одно определение.

Определение 10 [7, § 1.1, с. 18]. Множество A в пространстве \mathbb{R}^n называется *сильно выпуклым с постоянной R* , если существует непустое множество A_1 в \mathbb{R}^n , удовлетворяющее $A = \bigcap_{a \in A_1} \text{cl } B(a, R)$.

23. Условия на систему (5)

Уточним условия, налагаемые на систему (5) в \mathbb{R}^n .

- 1) Вектор-функция $f(t, x)$ и матрица-функция $\frac{\partial f(t, x)}{\partial x}$ непрерывны на $[t_0, T] \times \mathbb{R}^n$, выполняется $\left\| \frac{\partial f(t, x)}{\partial x} \right\| \leq C \in (0, \infty)$ на $[t_0, T] \times \mathbb{R}^n$ и $\frac{\partial f(t, x)}{\partial x}$ липшицева по x с константой L ;
- 2) Множество $X^{(0)}$ слабо выпукло по Ефимову-Стечкину с постоянной $R_0 > R_{\text{чеб.}}(X^{(0)})$;
- 3) Множество $B(t)P = \{B(t)u : u \in P\}$ сильно выпукло с постоянной r_p при $t \in [t_0, T]$;
- 4) Справедливо неравенство $r_p \leq CR_t$, где

$$R_t = \left(\frac{L}{6C} + \frac{1}{R_0} \right)^{-1} \exp(-6C(t - t_0)), \quad t \in [t_0, T]; \quad (6)$$

- 5) Справедливо неравенство

$$2R_{\text{чеб.}}(X^{(0)}) \leq (3e^{-C(T-t_0)} - 1)R_T. \quad (7)$$

24. Результат

Сформулируем утверждение, связывающее воедино три понятия: слабую выпуклость множеств в \mathbb{R}^n по Ефимову-Стечкину, сильную выпуклость множеств и α -множества.

Теорема 7 (о росте степени невыпуклости множеств достижимости) [9].

Пусть система (5) удовлетворяет условиям 1) – 5). Тогда для любого $t \in [t_0, T]$ справедлива оценка

$$\alpha_{X(t)} \leq \arccos \left(1 - \frac{(2e^{C(t-t_0)} R_{\text{чеб.}}(X^{(0)}) + (e^{C(t-t_0)} - 1)R_t)^2}{2R_t^2} \right). \quad (8)$$

Приведём пример, иллюстрирующий теорему 4.

25. Пример

Пример 1. В качестве примера рассмотрим следующую управляемую систему, в некотором смысле обобщающую систему из известной задачи Цермело. Итак, пусть движение корабля описывается системой:

$$\begin{cases} \dot{x}(t) = s(x) + u(t), & t > 0, \\ x(0) \in X^{(0)} = \left\{ x = (x_1, x_2) : |x_1| \leq \frac{1}{2}, x_2 = 0 \right\}, \end{cases} \quad (9)$$

где t — время, $x(t) = (x_1(t), x_2(t))$ — координаты корабля, $X^{(0)}$ — множество возможных начальных позиций корабля,

$s(x) = (s_1(x), s_2(x)) = \left(\sin \frac{x_2}{4}, \cos \frac{x_1}{4} \right)$ — скорость течения поверхности океана, $u(t) = (u_1(t), u_2(t))$ — собственная скорость корабля в спокойной воде.

Считаем, что корабль может управлять собственной скоростью в пределах $u(t) \in P = \{u = (u_1, u_2) : u_1^2 + u_2^2 \leq 1\}$.

26. Пример

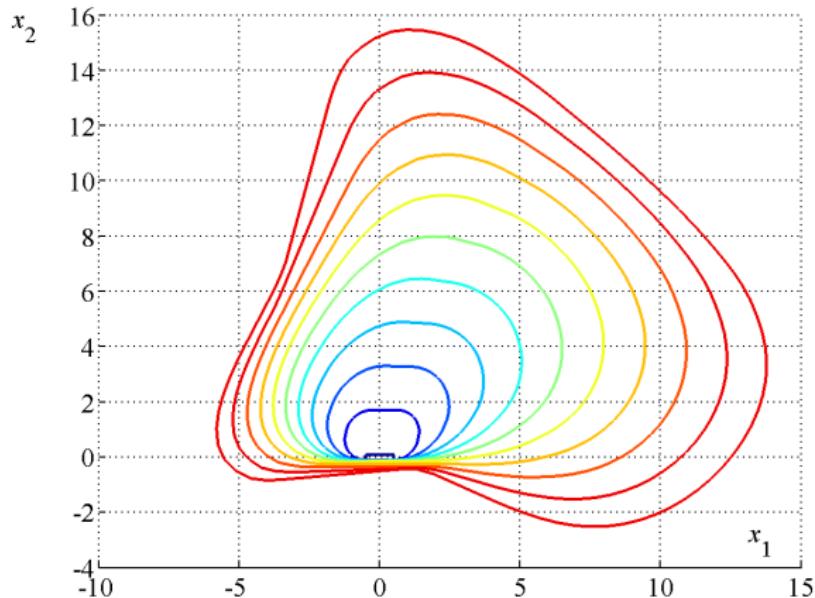


Рис. 13. Множества достижимости управляемой системы (9) на промежутке времени $t \in [0; 8]$

27. Пример

Применяя теорему 7, оценим степень невыпуклости множеств достижимости системы (9) и сравним теоретическую оценку с фактическими значениями.

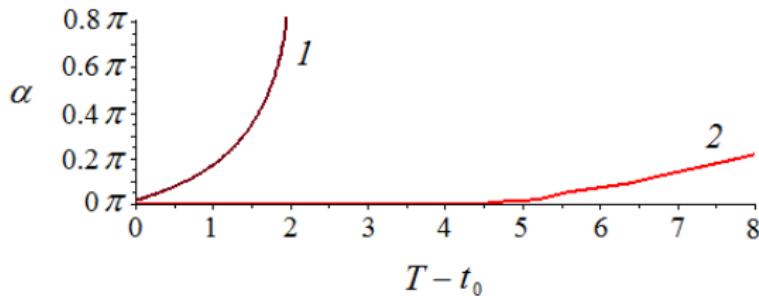


Рис. 14. Сравнение меры невыпуклости α множеств достижимости системы (9) и её оценки. 1 — оценка, 2 — экспериментально измеренные значения α

Раздел 4: численное вычисление меры невыпуклости α -множеств по их пиксельному представлению

29. О численном вычислении α

- В случае имеющейся априорной оценки слабой выпуклости множества достижимости [6, теорема 3.6.2] представляется возможным приближённое вычисление меры невыпуклости α по его пиксельному представлению.

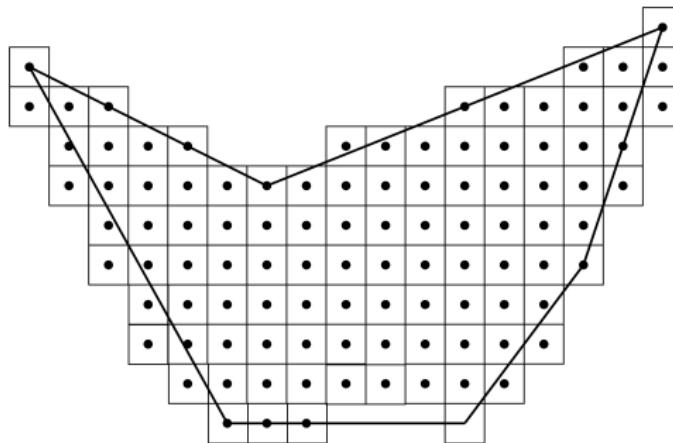


Рис. 15. Этап I: восстановление границы по пиксельному представлению множества

30. Этап II. вычисление меры невыпуклости многоугольника в \mathbb{R}^2 или многогранника в \mathbb{R}^3

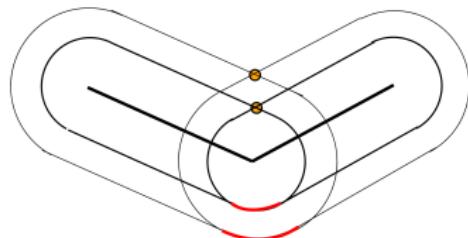


Рис. 16. Описание алгоритма

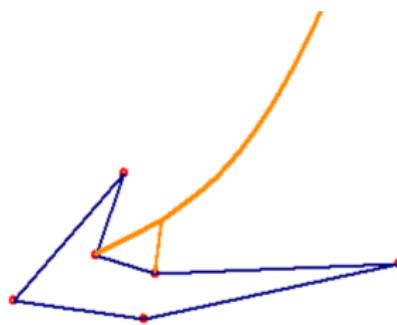


Рис. 17. Результат действия алгоритма ($\alpha = 0.619\pi$)

31. Этап II. вычисление меры невыпуклости многоугольника

Свойство 2 [2]. Функция $\alpha_A(z)$, $z \in \mathbb{R}^n \setminus A$, полунепрерывна сверху.

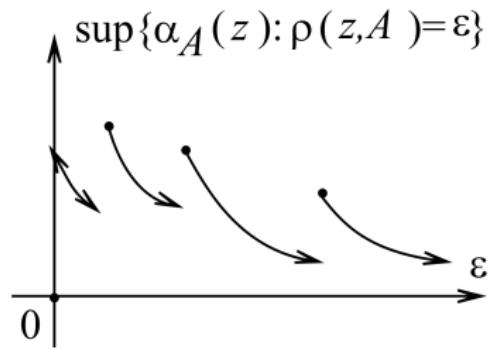


Рис. 18. Общий вид полунепрерывной сверху функции
 $f(\varepsilon) = \sup\{\alpha_A(z) : \rho(z, A) = \varepsilon\}$

Численный метод: $\alpha_M = \sup_{z^* \in \mathbb{R}^n \setminus M} \alpha_M(z^*) \approx \sup_{z^* : \rho(z^*, M) = \varepsilon k, k=1,2,3,\dots} \alpha_M(z^*)$

32. К обоснованию сходимости

- Заметим, что в отличие от исходного множества достижимости полученный многоугольник может уже не быть α -множеством (рис. 26).

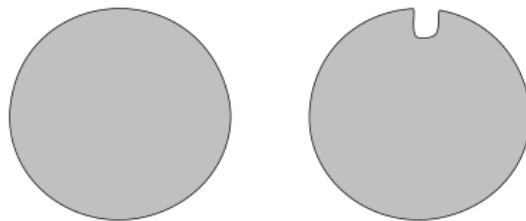


Рис. 19. Выпуклое 0-множество и максимально невыпуклое π -множество

- Однако, любое слабо выпуклое по Виалю с постоянной R множество обладает так называемым чебышёвским слоём толщины R , для всех точек из которого существует ровно одна метрическая проекция на это множество [7, теорема 1.7.1],

33. К обоснованию сходимости

- Иными словами, выполняется

Лемма 1. Если $A \subset \mathbb{R}^n$ — замкнутое, слабо выпуклое по Виалю с постоянной R множество, то

$$\alpha_A = \alpha_A^{(R)},$$

где $\alpha_A = \sup_{z^* \in \mathbb{R}^n \setminus A} \alpha_A(z^*)$, $\alpha_A^{(R)} = \sup_{z^* \in \mathbb{R}^n \setminus A_R} \alpha_A(z^*)$.

- В свою очередь, мера невыпуклости $\alpha_A^{(R)}$ устойчива к малым (в хаусдорфовой метрике) изменениям границы α -множества.
- Отметим, что многоугольники и многогранники обладают своего рода псевдочебышевским слоем некоторой толщины R , то есть для них также выполняется равенство мер невыпуклости $\alpha_A = \alpha_A^{(R)}$.

34. К обоснованию сходимости

Лемма 2. Пусть число $R > 0$, A и B — замкнутые множества в \mathbb{R}^2 .

Тогда $\alpha_A^{(R)} \rightarrow \alpha_B^{(R)}$ при $A \rightarrow B$ в хаусдорфовой метрике. а именно, если хаусдорфово расстояние $d(A, B) = \varepsilon$, то

$$|\alpha_B^{(R)} - \alpha_A^{(R)}| \leq 2 \arccos \left(1 - \frac{(2R^2 + 2R\varepsilon)}{(2r^2 + 2r\varepsilon)} \left(1 - \cos \frac{\alpha_A^{(R)}}{2} \right) \right) - \alpha_A^{(R)},$$

$$\text{где } r = \frac{(2R^2 + 2R\varepsilon) \left(1 - \cos \frac{\alpha_A^{(R)}}{2} \right)}{4\varepsilon + 2R \left(1 - \cos \frac{\alpha_A^{(R)}}{2} \right)}.$$

- Из приведённых утверждений вместе с полуунпрерывностью сверху функции $\alpha_A(z)$ по $z \in \mathbb{R}^2$ (см. [3, свойство 1.2]) следует сходимость рассматриваемой схемы приближённого вычисления меры невыпуклости слабо выпуклых α -множеств по их конечноточечным аппроксимациям.

35. Список литературы

1. Успенский А.А., Ушаков В.Н., Фомин А.Н. α -множества и их свойства / ИММ УрО РАН. Екатеринбург, 2004. 62 с. Деп. в ВИНИТИ 02.04.2004, № 543-В2004.
2. Ушаков В.Н., Успенский А.А. α -множества в конечномерных евклидовых пространствах и их свойства // Вестн. Удмуртск. ун-та. Матем. Мех. Компьют. науки. 2016. Т. 26, вып. 1. С. 95–120.
3. Ушаков В.Н., Успенский А.А. Теоремы об отделимости α -множеств в евклидовом пространстве // Тр. ИММ УрО РАН. 2016. Т. 22, № 2. С. 277–291.
4. Ushakov V.N., Ershov A.A., Pershakov M.V. Counterexamples in the theory of α -sets. In book: Bykadorov I., Strusevich V., Tchemisova T. (eds) Mathematical Optimization Theory and Operations Research. MOTOR 2019. Communications in Computer and Information Science, vol. 1090. Springer, Cham, pp. 329-340.

36. Список литературы

5. Ершов А.А., Кувшинов О.А. О свойствах пересечения α -множеств // Изв. ИМИ УдГУ. 2020. Т. 55. С. 79–92.
6. Стечкин С.Б., Ефимов Н.В. Опорные свойства множеств в банаховых пространствах и чебышевские множества // Докл. АН СССР. 1959. Т. 127, № 2. С. 254–257.
7. Иванов Г.Е. Слабо выпуклые множества и функции: теория и приложения. М.: Физматлит, 2006. 352 с.
8. Ушаков В.Н., Ершов А.А. Оценка роста степени невыпуклости множеств достижимости управляемых систем в терминах α -множеств // Доклады Российской академии наук. Математика, информатика, процессы управления. 2020. Т. 495. С. 73–79.

37. Список литературы

- 9. Ушаков В.Н., Ершов А.А., Матвийчук А.Р.** Об оценке степени невыпуклости множеств достижимости управляемых систем // Труды МИАН. 2021. Т. 315. С. 261–270.
- 10. Ушаков В.Н., Ершов А.А.** Об оценке степени невыпуклости множеств достижимости управляемых систем // Тр. ИММ УрО РАН. 2024. Т. 30, № 4. С. 276–285.
- 11. Грубер П.М., Леккеркеркер К.Г.** Геометрия чисел. М.: Наука, 2008. 728 с.
- 12. Ершов А.А., Першаков М.В.** О соотношении альфа-множеств с другими обобщениями выпуклых множеств // VI Информационная школа молодого ученого : сб. науч. тр. / отв. ред. П. П. Трескова ; сост. А. И. Кирсанова, Ю. Д. Прокофьева, А. С. Павлова. Екатеринбург, 2018. 217 с. — С. 143–150.

Спасибо за внимание!