

# ОЦЕНИВАНИЕ МНОЖЕСТВ РЕШЕНИЙ СИСТЕМ ИНТЕРВАЛЬНЫХ ПОЛИНОМИАЛЬНЫХ УРАВНЕНИЙ

*Людвин Д.Ю.*

*Институт вычислительных технологий СО РАН*

*г. Новосибирск*

# Постановка задачи

Рассмотрим систему полиномиальных уравнений

$$F(X) = 0, \quad (\star)$$

где  $F(X)$  — вектор полиномов

$$f_i(x_1, x_2, \dots, x_n) = \sum_{k_1=0}^{K_1} \sum_{k_2=0}^{K_2} \dots \sum_{k_n=0}^{K_n} a_{(i)k_1 k_2 \dots k_n} x_1^{k_1} x_2^{k_2} \dots x_n^{k_n}.$$

Обозначим через  $P = (p_j)$  вектор коэффициентов полиномов  $f_i$ .

Рассматривая  $f_i(x_1, x_2, \dots, x_n)$  как функцию  $\varphi_i(X, P)$ , зависящую от переменной  $X = (x_i)$  и параметра  $P = (p_j)$ , принимающего значения из заданного бруса  $P = (p_j)$ , запишем систему  $(\star)$  в виде

$$\Phi(X, P) = 0 \quad \text{или} \quad \varphi_i(X, P) = 0, \quad i = 1, \dots, n.$$

Возьмем интервальное расширение функции  $G(X, P)$  на брус  $P$ , получим систему интервальных полиномиальных уравнений

$$\Phi(X, P) = 0 \quad \text{или} \quad \varphi_i(X, P) = 0, \quad i = 1, \dots, n.$$

Под интервальным полиномом  $\varphi_i(X, P)$  будем понимать множество вещественных полиномов  $\varphi_i(X, P)$  с коэффициентами  $P \in P$ .

Множество решений интервальной системы  $\Phi(X, P) = 0$  определим как

$$\Xi(\Phi, P) = \{X \in \mathbb{R}^n \mid (\exists P \in P)(\Phi(X, P) = 0)\}.$$

В работе рассматриваются задачи:

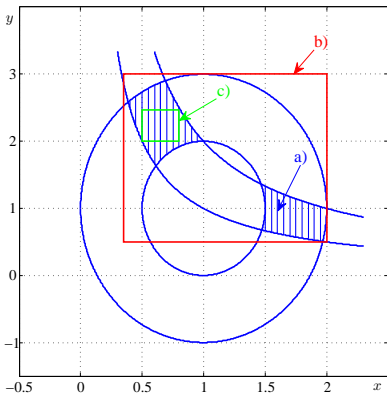
- внешнего оценивания множества решений, т.е. нахождения наименьшего бруса  $V \supseteq \Xi(\Phi, P)$ ,
- внутреннего оценивания множества решений, т.е. нахождения наибольшего бруса  $U \subseteq \Xi(\Phi, P)$ .

## Пример 1

Рассмотрим интервальную систему уравнений

$$\begin{cases} 4x^2 - 8x + y^2 + p_1 = 0, \\ xy + p_2 = 0, \end{cases}$$

где  $p_1 = [1, 4]$ ,  $p_2 = [-2, -1]$ . На рисунке изображены: (a) — множество решений системы уравнений, (b) — внешняя оценка и (c) — внутренняя оценка.



## Внешняя оценка множества значений интервального полинома одной переменной

Интервальный полином  $f(x) = a_0 + a_1x + a_2x^2 + \dots + a_nx^n$  можно ограничить вещественными функциями

$$f^l(x) = \sum_{i=0}^n \text{low}(\mathbf{a}_i, x, i) \quad \text{и} \quad f^u(x) = \sum_{i=0}^n \text{up}(\mathbf{a}_i, x, i),$$

где

$$\text{low}(\mathbf{a}_i, x, i) = \begin{cases} \underline{a}_i x^i, & \text{если } x \geq 0 \text{ или } i\text{-четное,} \\ \bar{a}_i x^i, & \text{в противном случае,} \end{cases}$$

$$\text{up}(\mathbf{a}_i, x, i) = \begin{cases} \bar{a}_i x^i, & \text{если } x \geq 0 \text{ или } i\text{-четное,} \\ \underline{a}_i x^i, & \text{в противном случае.} \end{cases}$$

Внешняя оценка множества значений полинома  $f(x)$  на  $x$

$$f(x) = [ \underline{f}^l(x), \bar{f}^u(x) ],$$

где  $\underline{f}^l(x)$  и  $\bar{f}^u(x)$  — интервальные расширения ограничивающих функций на  $x$ , вычисленные с использованием схемы Горнера.

## Вложенная форма представления интервального полинома $n$ переменных

Представим интервальный полином

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) = \sum_{k_1=0}^{K_1} \sum_{k_2=0}^{K_2} \dots \sum_{k_n=0}^{K_n} a_{k_1 k_2 \dots k_n} x_1^{k_1} x_2^{k_2} \dots x_n^{k_n}$$

в виде

$$q(x_n) = q_0 + \dots + q_{k_n} x_n^{k_n} + \dots + q_{K_n} x_n^{K_n},$$

где

$$q_{k_n}(x_{n-1}) = q_{k_n 0} + \dots + q_{k_n k_{n-1}} x_{n-1}^{k_{n-1}} + \dots + q_{k_n K_{n-1}} x_{n-1}^{K_{n-1}},$$

$$q_{k_n k_{n-1}}(x_{n-2}) = q_{k_n k_{n-1} 0} + \dots + q_{k_n k_{n-1} k_{n-2}} x_{n-2}^{k_{n-2}} + \dots + q_{k_n k_{n-1} K_{n-1}} x_{n-2}^{K_{n-1}},$$

⋮

$$q_{k_n \dots k_2}(x_1) = q_{k_n \dots k_2 0} + \dots + q_{k_n \dots k_2 k_1} x_1^{k_1} + \dots + q_{k_n \dots k_2 K_1} x_1^{K_1},$$

$$q_{k_n \dots k_2 k_1} = a_{k_1 k_2 \dots k_n}.$$

## Внешняя оценка множества значений полинома на заданном брус

- 1 Находим внешние оценки множеств значений полиномов  $q_{k_n \dots k_2}(x_1)$  ( $k_j = 0, \dots, K_j$  и  $j = 2, \dots, n$ ) на интервале  $x_1$ . Для каждого из этих полиномов находим ограничивающие его вещественные полиномы  $q_{k_n \dots k_2}^l(x_1)$  и  $q_{k_n \dots k_2}^u(x_1)$  и вычисляем их интервальные расширения на  $x_1$ . В качестве искомой внешней оценки берем

$$q_{k_n \dots k_2}(x_1) = [q_{k_n \dots k_2}^l(x_1), \bar{q}_{k_n \dots k_2}^u(x_1)].$$

- 2 Подставив найденные интервалы в качестве коэффициентов полиномов относительно переменной  $x_2$ , получаем интервальные полиномы  $q_{k_n \dots k_3}(x_2)$  и аналогично пункту 1 вычисляем внешние оценки их множеств значений на  $x_2$ .
- 3 Далее аналогично пункту 2 оцениваем множества значений интервальных полиномов относительно переменных  $x_3, \dots, x_n$  на интервалах  $x_3, \dots, x_n$  соответственно. Внешняя оценка исходного интервального полинома  $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$  на брус  $\mathbf{X} = (x_1, \dots, x_n)^\top$  есть

$$f(x_1, x_2, \dots, x_n) = q(x_n).$$

## Интервальные корни интервального полинома одной переменной

Пусть интервальный полином  $f(x) = \sum_{i=0}^n a_i x^i$  ограничен вещественными полиномами  $f^l(x)$  и  $f^u(x)$  и существует число  $\hat{x} \in \mathbb{R}$  такое, что  $0 \in [f^l(\hat{x}), f^u(\hat{x})]$ .

**Интервальный корень** полинома  $f(x)$  определим как наибольший интервал  $r$ , содержащий  $\hat{x}$  и такой, что для любой точки  $x \in r$  имеет место включение

$$0 \in [f^l(x), f^u(x)].$$

Интервальный корень  $r$  может быть

- конечным интервалом  $[r_1, r_2]$ , как вырожденным, так и невырожденным,
- полубесконечным интервалом  $(-\infty, r_3]$  или  $[r_4, +\infty)$ ,
- всей числовой осью.

Здесь  $r_j \in \mathbb{R}, j = \overline{1, 4}$ .



Пусть  $r_1 < \dots < r_j < \dots < r_k$  — различные корни полиномов  $f^l(x)$  и  $f^u(x)$ , ограничивающих интервальный полином  $f(x)$ . Рассмотрим интервалы  $r_1 = (-\infty, r_1], \dots, r_j = [r_{j-1}, r_j], \dots, r_{k+1} = [r_k, +\infty)$ .

Невырожденный интервал  $r_j$ ,  $j = 1, \dots, k + 1$ , является интервальным корнем полинома  $f(x)$ , если

$$0 \in [f^l(s), f^u(s)],$$

где  $s$  принадлежит внутренности интервала  $r_j$ .

Вырожденный интервал  $[r_j, r_j]$ ,  $j = 1, \dots, k$ , является интервальным корнем полинома  $f(x)$ , если

$$0 \notin [f^l(s'), f^u(s')] \quad \text{и} \quad 0 \notin [f^l(s''), f^u(s'')],$$

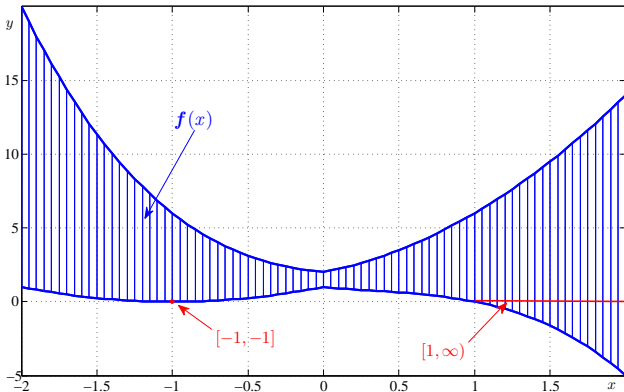
где  $s'$  и  $s''$  принадлежат внутренностям интервалов  $r_j$  и  $r_{j+1}$  соответственно.

## Пример 2

Рассмотрим интервальный полином

$$f(x) = [-1, 0]x^3 + [1, 2]x^2 + [-1, 2]x + [1, 2].$$

На рисунке изображены графики функций, ограничивающих интервальный полином, а также его корни  $[1, +\infty)$  и  $[-1, -1]$ .



## Интервальный метод Ньютона

Пусть  $X = x_1 \times \dots \times x_n \in \mathbb{I}\mathbb{R}^n$  брус, на котором будем искать решение системы  $\Phi(X, P) = 0$ . Итерационный метод Ньютона на основе наклонов определим следующим образом

$$\begin{cases} X^{(0)} := X, \\ X^{(k+1)} := X^{(k)} \cap \mathcal{N}(X^{(k)}, X^{(k)}, P), \quad k = 0, 1, 2, \dots \end{cases}$$

## Оператор Ньютона

$$\mathcal{N}(X^{(k)}, X^{(k)}, P) = X_0 + \text{Encl}(\Phi^{\angle}(X^{(k)}, X^{(k)}, P), -\Phi(X^{(k)}, P)).$$

## Обозначения:

$X^{(k)}$  середина бруса  $X^{(k)}$ ;

$\Phi^{\angle}(X^{(k)}, X^{(k)}, P)$  интервальный многомерный наклон функции  $\Phi(X, P)$  на брус  $X^{(k)} \times P$  относительно точки  $X^{(k)}$ ;

$\text{Encl}(\Phi^{\angle}(X^{(k)}, X^{(k)}, P), -\Phi(X^{(k)}, P))$  внешняя оценка множества решений интервальной линейной системы уравнений  $\Phi^{\angle}(X^{(k)}, X^{(k)}, P)(X - X^{(k)}) = -\Phi(X^{(k)}, P)$ , полученная с помощью процедуры *Encl*.

## Анализ совместности по брусу

Используя вложенную форму представления интервального полинома и алгоритм внешнего оценивания множества его значений, представим  $i$ -е ( $i = \overline{1, n}$ ) уравнение  $\varphi_i(X, \mathbf{p}_i) = 0$  системы  $\Phi(X, \mathbf{P}) = 0$  в виде

$$\mathbf{q}_i(x_j) = 0, \quad (*)$$

где  $\mathbf{q}_i(x_j) = \sum_{k_j=0}^{K_j} \mathbf{q}_{k_j} x_j^{k_j}$  — интервальный полином степени  $K_j$  относительно переменной  $x_j$ .

Вычислим интервальные корни  $\mathbf{r}_1, \dots, \mathbf{r}_m$  уравнения (\*) и найдём их пересечения с  $j$ -ой компонентой  $x_j$  исходного бруса  $\mathbf{X}$ . Пусть

$$W_j = \bigcup_{s=1}^m (\mathbf{r}_s \cap x_j).$$

Брус  $\hat{\mathbf{X}} = (x_1, \dots, x_{j-1}, \square W_j, x_{j+1}, \dots, x_n)$ , где  $\square W_j$  — интервальная оболочка  $W_j$ , содержит множество решений системы  $\Phi(X, \mathbf{P}) = 0$  и в случае  $\hat{\mathbf{X}} \subset \mathbf{X}$  является его более точной внешней оценкой.

## Процедура дробления брусов

**Шаг 1** Заносим брус  $X$  в список  $\mathcal{L}$ . Инициализируем пустой брус  $V$ .

**Шаг 2** Если  $\mathcal{L}$  пуст, то переходим на шаг 4, в противном случае извлекаем из  $\mathcal{L}$  первую запись, которую обозначим через  $Y$ . Удаляем первую запись из  $\mathcal{L}$ . Если максимальная ширина компонент бруса  $Y$  меньше  $\varepsilon > 0$ , то  $V := \square V \cup Y$  и переходим на шаг 2.

**Шаг 3** Применяем к  $Y$  процедуру сжатия, получаем брус  $Z$ . Если  $Z = \emptyset$ , то переходим на шаг 2. В противном случае дробим  $Z$  по компоненте, для которой максимальна величина

$$\text{wid } z_j \cdot \sum_{i=1}^n |\varphi_{ij}^{\angle}(Z, P, \tilde{Z})|,$$

где  $\tilde{Z} = \text{mid } Z$ . Заносим полученные брусы  $Z'$  и  $Z''$  в список  $\mathcal{L}$  и переходим на шаг 2.

**Шаг 4** Принимаем  $V$  в качестве искомой внешней оценки и заканчиваем работу алгоритма.

## Процедура сжатия бруса

**Шаг 1** Выполняем проверку, содержит ли брус  $Y$  решения системы уравнений

$$\varphi_i(X, P) = 0, \quad i = 1, \dots, n.$$

- Используя вложенную форму представления и алгоритм внешнего оценивания множества значений интервального полинома находим интервальные расширения  $\varphi_i(Y, P)$  функций  $\varphi_i(X, P)$  на брус  $Y$ .
- Если хотя бы один из интервалов  $\varphi_i(Y, P)$  не содержит 0, то брус  $Y$  может быть исключен из рассмотрения. В этом случае полагаем  $Z = \emptyset$  и переходим на шаг 3.

**Шаг 2** К брусу  $Y$  применяем процедуру анализа совместности и многомерный интервальный метод Ньютона. Полученный в результате брус присваиваем  $Z$ .

**Шаг 3** Принимаем  $Z$  в качестве результата сжатия бруса  $Y$  и заканчиваем работу процедуры.

## Внутренняя интервальная оценка множества решений системы интервальных полиномиальных уравнений

- Этап 1** Пусть  $X^* = (x_1^*, \dots, x_n^*) \in X$ , например,  $X^* = \text{mid } X$ .  
Находим для некоторого  $k = 1, \dots, n$  ближайший к точке  $X^*$  отрезок прямой, проходящей через эту точку параллельно  $k$ -ой оси координат и принадлежащий множеству  $\Xi(\Phi, P) \cap X$ .  
Если ни одна из прямых, проходящих через точку  $X^*$  параллельно осям координат, не пересекает множество  $\Xi(\Phi, P) \cap X$ , то необходимо выбрать другую точку  $X^*$ , например, найти некоторое приближение решения системы уравнений  $\Xi(X, \text{mid } P) = 0$ .
- Этап 2** Пусть найденный отрезок имеет вид:  $\underline{r} \leq x_k \leq \bar{r}$ ,  $x_j = x_j^*$ , где  $j \neq k$ . Интервал  $[\underline{r} + \varepsilon, \bar{r} - \varepsilon]$ , где  $\varepsilon > 0$ , разбиваем на  $m$  непересекающихся подынтервалов  $d^{(s)}$ ,  $s = \overline{1, m}$ , одинаковой ширины, таких что  $[\underline{r} + \varepsilon, \bar{r} - \varepsilon] = \bigcup_{s=1}^m d^{(s)}$ . Для каждого интервала  $d^{(s)}$  вычисляем брус  $U^{(s)}$ , который является внутренней оценкой множества  $\Xi(\Phi, P) \cap X$ .

## Этап 1

Прямая, проходящая через точку  $X^* = (x_1^*, \dots, x_n^*) \in X$  параллельно  $k$ -ой оси координат описывается системой уравнений

$$x_j = x_j^*, \quad j = 1, \dots, n, \quad j \neq k \quad (\star)$$

Подставив  $(\star)$  в систему  $\Phi(X, P) = 0$ , получим систему полиномиальных уравнений относительно  $x_k$

$$\varphi_i(x_1^*, \dots, x_{k-1}^*, x_k, x_{k+1}^*, \dots, x_n^*, p_i) = 0, \quad i = 1, \dots, n. \quad (\star\star)$$

Если множество решений  $i$ -го уравнения системы  $(\star\star)$  не пусто, вычисляем ближайший к  $x_k^*$  интервал  $r_i$ , принадлежащий этому множеству и интервалу  $x_k$ . В противном случае прямая  $(\star)$  не пересекает  $\Xi(\Phi, P) \cap X$ .

Искомый отрезок задается соотношениями

$$\underline{r} \leq x_k \leq \bar{r}, \quad x_j = x_j^*, \quad j \neq k,$$

где  $r = \bigcup_{i=1}^n r_i$ .



## Этап 2

- 1 Присваиваем  $k$ -ой компоненте  $U^{(s)}$  интервал  $d^{(s)}$ , т.е.  $u_k^{(s)} := d^{(s)}$ .
- 2 Остальные компоненты  $u_j^{(s)}$ ,  $j = \overline{1, n}$ ,  $j \neq k$ , находим следующим образом.

Вычисляем отрезки прямых, проходящих через точки

$$(x_1^*, \dots, x_{k-1}^*, \underline{d}^{(s)}, x_{k+1}^*, \dots, x_n^*) \text{ и } (x_1^*, \dots, x_{k-1}^*, \bar{d}^{(s)}, x_{k+1}^*, \dots, x_n^*)$$

параллельно  $j$ -ой оси координат и принадлежащие множеству  $\Xi(\Phi, P) \cap X$ .

Пусть  $j$ -ая координата точек первого и второго отрезков удовлетворяет соответственно неравенствам

$$t_1^l \leq x_j \leq t_1^u \quad \text{и} \quad t_2^l \leq x_j \leq t_2^u.$$

Присваиваем

$$u_j^{(s)} := [\max\{t_1^l, t_2^l\}, \min\{t_1^u, t_2^u\}].$$

### Пример 3

Пусть  $X = (x_1, x_2)^\top$  — вектор перемещений торца лопатки силовой установки,  $C = (c_1, c_2)^\top$  — вектор цифровых кодов, значения которых с учётом погрешностей измерения задаются интервалами  $c_i = [\underline{c}_i, \bar{c}_i]$ ,  $i = 1, 2$ .

Вычисление перемещений торца лопатки, соответствующих вектору цифровых кодов  $C$ , на основе градуировочных характеристик, имеющих вид интервальных полиномов

$$f_i(x_1, x_2) = \sum_{k_1=0}^2 \sum_{k_2=0}^2 a_{(i)k_1k_2} x_1^{k_1} x_2^{k_2}, \quad i = 1, 2,$$

сводится к задаче оценивания множества решений системы интервальных полиномиальных уравнений

$$f_i(x_1, x_2) = c_i, \quad i = 1, 2,$$

на заданном брусе  $X$ .

## Коэффициенты интервальных полиномов

$a_{(1)00}$	$=$	$[2557.3632, 2567.3632]$	$a_{(2)00}$	$=$	$[3037.7782, 3053.7782]$
$a_{(1)01}$	$=$	$-221.0272$	$a_{(2)01}$	$=$	$-218.5782$
$a_{(1)02}$	$=$	$70.5782$	$a_{(2)02}$	$=$	$80.1020$
$a_{(1)10}$	$=$	$-297.6301$	$a_{(2)10}$	$=$	$317.1479$
$a_{(1)11}$	$=$	$301.4891$	$a_{(2)11}$	$=$	$-342.3596$
$a_{(1)12}$	$=$	$-93.0325$	$a_{(2)12}$	$=$	$112.5637$
$a_{(1)20}$	$=$	$58.3290$	$a_{(2)20}$	$=$	$30.1870$
$a_{(1)21}$	$=$	$-88.8764$	$a_{(2)21}$	$=$	$10.7886$
$a_{(1)22}$	$=$	$36.0065$	$a_{(2)22}$	$=$	$-19.9298$

## Значения цифровых кодов

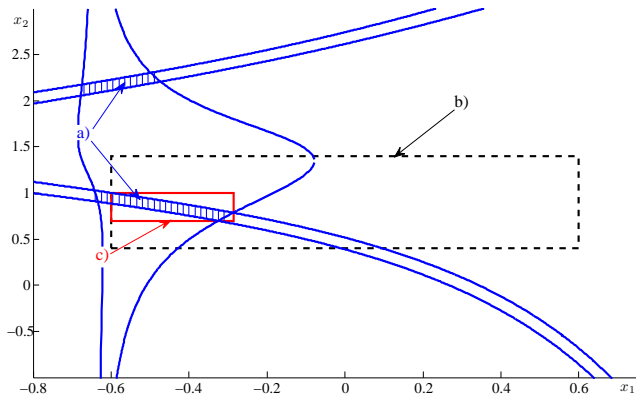
$c_1$	$=$	$[2472, 2482]$	$c_2$	$=$	$[2868, 2884]$
-------	-----	----------------	-------	-----	----------------

Исходный брус был задан на основе физических соображений в виде  $\mathbf{X} = ([-0.6, 0.6], [0.4, 1.4])^T$ .

## Результаты внешнего оценивания

На рисунке изображены

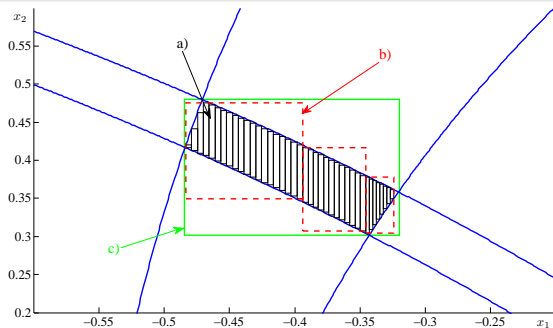
- a) множество решений системы интервальных полиномиальных уравнений,
- b) исходный брус  $X$ ,
- c) внешняя оценка  $V = [-0.6000, -0.2861] \times [0.6978, 1.0024]$ .



## Результаты внутреннего оценивания

На рисунке изображены

- a) внутренние оценки,
- b) интервальные оболочки внутренних оценок, полученных в результате трех итераций алгоритма:  
 $U_1 = [-0.4834, -0.3938] \times [0.3478, 0.4766]$ ,  
 $U_2 = [-0.3938, -0.3456] \times [0.3068, 0.4175]$ ,  
 $U_3 = [-0.3457, -0.3241] \times [0.3039, 0.3783]$ ,
- c) интервальная оболочка множества решений на брусе  $X$ .



## Заключение

В работе предложен алгоритм получения внешней оценки множества решений системы интервальных полиномиальных уравнений, основанный на

- интервальном методе распространения ограничений,
- многомерном интервальном методе Ньютона,
- методах дробления решений.

Разработан и реализован алгоритм внутреннего оценивания множества решений системы интервальных полиномиальных уравнений. В целях наилучшего исчерпывания множества решений предлагается строить регулярное покрытие этого множества брусами.

Представлены результаты численных экспериментов.

*Спасибо за внимание*