

Optimization Problems in Fixed Point Theory

東工大理 高橋 渉 (Wataru Takahashi)

不動点理論は最適化理論との関連において様々な形で研究され、発展してきた。不動点の存在は写像 f のもつ性質と作用する空間 X の性質によって決まってくるが、応用上大切な不動点定理を空間の条件によって分けると、つぎの3つの場合になるだろう。(1) X が完備距離空間の場合; (2) X が Banach 空間の有界凸閉集合の場合; (3) X が線形位相空間のコンパクト凸集合の場合である。(1) の場合は縮小写像の不動点定理 (Banach Contraction Principle) がその代表的なものであり、また最近ではこれを拡張した Caristi の不動点定理 [7] がある。これは Ekeland の ε -variational principle [10] とも“同値”である。これらの定理は距離空間の完備性を目一杯使っている点に特徴があり、最適化理論においてはコンパクト性なしの存在定理を証明するのに有効である。完備距離空間での集合値写像の不動点定理では Banach Contraction 原理を拡張した Nadler の定理 [19] がある。この定理が上の定理

(Caristiの定理, Ekelandの定理)から証明されることは興味深いことである。(2)の場合は非拡大写像(nonexpansive mapping)の不動点定理がある。これは1965年にBrowder [4]やKirk [15], Göhde [13]によって独立に証明されたものであるが、後にこの定理が写像の族の共通不動点定理に拡張され、最小化問題や凸解析学、非線形発展方程式等と結びついて最近のトピックスになっているところである。集合値写像の不動点定理としてはMarkin [18], Lim [17]等によって証明された非拡大写像の不動点定理がある。(3)の場合はBrouwerの不動点定理やSchauder, そしてTychonoffの不動点定理がある。これらの定理は様々な形に変形され、最適化理論に応用されている。写像の族に対する不動点定理にはMarkov-Kakutaniの不動点定理 [9]やDayの不動点定理 [8]がある。また集合値写像の不動点定理にはFanの定理やFan-Browderの定理 [6]がある。これらはminimax定理や凸不等式に関する定理などを介在にしてやはり最適化理論を研究する上で重要なものとなる。

ここでは、(1), (2)の場合に限定して、最適化理論との関連において非線形関数の最小化問題の解の存在とその近似法を考える。(1)では空間に凸性のない(凸関数でない)下半連続関数の最小値定理とその応用について述べる。(2)では

凸関数の最小化問題の解の近似法を一般的な形で考える。1つは凸関数の劣微分を一般化した増大作用素のリゾルベントの漸近的挙動の研究であり、他の1つは非拡大写像エルゴード定理である。これは1967年に証明された Browder の強収束定理 [5] と 1975年に Baillon に よって証明された非線形エルゴード定理 [1] に端を発するものである。

§1 Nonconvex minimization theorem.

この節では、完備距離空間上で定義された下半連続関数の最小値定理とその応用について述べる。

集合 S 上で定義され、値を $(-\infty, \infty]$ にとる関数 f が下に有界であるとは、ある実数 M が存在して

$$M \leq f(t), \quad \forall t \in S$$

となるときをいう。

定理1 X を完備距離空間とし、 f を X から $(-\infty, \infty]$ への下半連続で、下に有界な関数とする。このとき、

$$\inf \{ f(x) : x \in X \} < f(u)$$

となる $u \in X$ に対して、 $u \neq v$ かつ $f(v) + d(u, v) \leq f(u)$ となる元 $v \in X$ が存在するならば

$$f(x_0) = \inf \{ f(x) : x \in X \}$$

となる $x_0 \in X$ が存在する。

証明 すべての X の元 y に対し、 $\inf \{ f(x) : x \in X \} < f(y)$

と仮定する。 X の元 u に対し, $u_0 = u$ とし, あとは帰納的に u_n ($n=1, 2, 3, \dots$) をつぎのように定義する。 u_{n-1} ($n=1, 2, \dots$) が知られてゐるとし, S_n を

$$S_n = \{w \in X : f(w) + d(u_{n-1}, w) \leq f(u_{n-1})\}$$

とし, $u_n \in S_n$ を

$$f(u_n) \leq \inf_{w \in S_n} f(w) + \frac{1}{2} \{f(u_{n-1}) - \inf_{w \in S_n} f(w)\}$$

となるようにとる。このように $u_n \in S_n$ が存在するとは

$$\frac{1}{2} \{f(u_{n-1}) - \inf_{w \in S_n} f(w)\} > 0$$

であるからである。このようにしてつづつた点列 $\{u_n\}$ はコーシー列である。実際 $n < m$ とすると

$$\begin{aligned} d(u_n, u_m) &\leq \sum_{k=n}^{m-1} d(u_k, u_{k+1}) \\ &\leq \sum_{k=n}^{m-1} \{f(u_k) - f(u_{k+1})\} \\ &= f(u_n) - f(u_m) \quad \dots (*) \end{aligned}$$

となる。 $\{f(u_n)\}$ は下に有界な減少列であるから収束する。よって $\{u_n\}$ はコーシー列である。 $\{u_n\}$ の極限を v とし, (*) で $m \rightarrow \infty$ とすると

$$d(u_n, v) \leq f(u_n) - \lim_{m \rightarrow \infty} f(u_m) \leq f(u_n) - f(v)$$

となる。仮定より、この v に対し $z \neq v$ で $f(z) + d(z, v) \leq f(v)$

となる $z \in X$ が存在する。よって

$$\begin{aligned} f(z) &\leq f(v) - d(z, v) \\ &\leq f(v) - d(z, v) + f(u_n) - f(v) - d(u_n, v) \\ &= f(u_n) - \{d(z, v) + d(u_n, v)\} \\ &\leq f(u_n) - d(z, u_n). \end{aligned}$$

これから $z \in S_{n+1}$ 。これらはすべての n についていえるので $z \in S_n$ である。

$$2 f(u_n) - f(u_{n-1}) \leq \inf_{w \in S_n} f(w) \leq f(z)$$

であるので $f(z) < f(v) \leq \lim_{n \rightarrow \infty} f(u_n) \leq f(z)$

を得る。これは矛盾である。よって $f(x_0) = \inf \{f(x) : x \in X\}$ となる $x_0 \in X$ が存在する。

上の定理を用いると、Caristi の不動点定理がただちに得られる。

系 (Caristi) X を完備距離空間とし、 f を X から \mathbb{R} への下半連続で、下に有界な関数とする。また T を X から X へのつぎの条件をみたす写像とする。

$$d(x, Tx) \leq f(x) - f(Tx), \quad \forall x \in X.$$

このとき、 $Tx_0 = x_0$ となる点 $x_0 \in X$ が存在する。

証明 すべての $x \in X$ について、 $Tx \neq x$ としよう。このと

き、すべての $x \in X$ について、 $x \neq w$ で $f(w) + d(x, w) \leq f(x)$ となる $w \in X$ が存在することになる。実際、 $w = Tx$ とすればよい。上の定理を用いると、 $f(x_0) = \inf \{ f(x) : x \in X \}$ となる $x_0 \in X$ が存在する。この $x_0 \in X$ に対して

$$0 < d(x_0, Tx_0) \leq f(x_0) - f(Tx_0) \leq f(Tx_0) - f(Tx_0) = 0$$

となり、矛盾を得る。

定理1から、Nadlerの不動点定理や nonconvex minimization problems で有用な Ekelandの ε -変分不等式も簡単に証明できる [25]。

§2 収束定理

この節では増大作用素のリゾルベントの収束定理と non-expansive 半群の非線形エルゴード定理を述べる。

E を Banach空間とし、 I を E 上の恒等写像とする。このとき、 $A \subset E \times E$ が増大作用素であるとは、任意の $(x_1, y_1), (x_2, y_2) \in A$ と $r > 0$ に対してつねに

$$\|x_1 - x_2\| \leq \|x_1 - x_2 + r(y_1 - y_2)\|$$

が成り立つときをいう。多価写像 A に対して、その定義域および値域は $D(A), R(A)$ で表される。 A が増大作用素であるとき、任意の $r > 0$ に対して、そのリゾルベントは

$$J_r = (I + rA)^{-1}$$

で定義される。また $A_r = (I - J_r)/r$ は吉田近似といわれる。

よく知られた事実であるが、任意の $x \in R(I+rA)$ に対してつねに $A_r x \in A J_r x$ が成り立つ。また $x \in D(A) \cap R(I+rA)$ に対してつねに $\|A_r x\| \leq |Ax|$ である。ただし、

$$|Ax| = \inf \{ \|y\| : y \in Ax \}$$

である。任意の $r > 0$ に対して、 $D(A)$ の閉包 $\overline{D(A)}$ が $R(I+rA)$ に含まれるとき、 A は値域条件をみたすといわれる。すべての $r > 0$ に対して、 $R(I+rA) = E$ であるとき、 A は m -増大作用素であるといわれる。 C を Banach 空間 E の閉凸集合とし、 T を C から C への nonexpansive 写像とするとき、 $A = I - T$ は値域条件を満たす増大作用素である。また、 H を Hilbert 空間とし、 f を H から $(-\infty, \infty]$ への proper で凸な下半連続関数とする。このとき H から H への多価写像 ∂f は

$$\partial f(x) = \{ x^* \in H : f(y) \geq f(x) + (x^*, y-x), \forall y \in H \}$$

で定義され、 f の劣微分といわれる。これは m -増大作用素である。Hilbert 空間上の m -増大作用素 A に対して、初期値問題は、 $x \in D(A)$ に対して

$$\frac{du(t)}{dt} + Au(t) \ni 0, \quad 0 < t < \infty,$$

$$u(0) = x$$

で定義されるが、これは一意の解 $u: [0, \infty) \rightarrow H$ を持つ。いま $x \in D(A)$ と $t \geq 0$ に対して

$$S(t)x = u(t)$$

で $S(t)$ を定義すると, これは $D(A)$ 上で nonexpansive 写像となり, よって閉凸集合 $\overline{D(A)}$ 上に拡張される. すなわち, $\{S(t); t \geq 0\}$ はつぎの条件を満たす $\overline{D(A)}$ 上の nonexpansive 半群になるのである.

- (1) $S(t+s)x = S(t)S(s)x, \forall t, s \in [0, \infty), x \in \overline{D(A)}$;
- (2) $S(0)x = x, \forall x \in \overline{D(A)}$;
- (3) 任意の $x \in \overline{D(A)}$ に対し, $t \mapsto S(t)x$ は連続である;
- (4) $\|S(t)x - S(t)y\| \leq \|x - y\|, \forall x, y \in \overline{D(A)}, t \in [0, \infty)$.

とくに, $A = \partial f$ のときは

$$f(x_0) = \min_{x \in H} f(x) \iff 0 \in \partial f(x_0) \iff x_0 \in \bigcap_{t \geq 0} F(S(t))$$

である. ただし, $F(S(t))$ は $S(t)$ の不動点の集合である. だから凸関数の最小化問題の研究は, 増大作用素や nonexpansive 半群の研究となるのである.

$A \subset E \times E$ を値域条件を満たす増大作用素とし, $\{r_n\}$ を正の実数からなる数列とする. $x_0 \in \bigcap_{r > 0} R(I+rA)$ に対し, つぎの点列を考える.

$$x_{n+1} = J_{r_n} x_n, \quad n=0, 1, 2, \dots, \quad \dots (**)$$

$$\sum_{n=0}^{\infty} r_n = \infty.$$

このような点列の挙動の研究は Brezis-Lions [3], Pazy [20], Rockafellar [21] 等によつて, E が Hilbert 空間の場合に研究されたが, Banach 空間の場合にはつぎのような定理になる.

補助定理 E を Banach 空間とし, $A \in E \times E$ を値域条件を満たす増大作用素とする. $x_0 \in \bigcap_{r>0} R(I+rA)$ に対し, $\{x_n\}$ を (***) によつて定義された点列とすると

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{\|x_0 - x_n\|}{\sum_{i=0}^{n-1} r_i} = d(0, R(A)).$$

定理 2 (Jung-Takahashi) E を E^* が Fréchet 微分可能なノルムを持つ Banach 空間とし, $A \in E \times E$ を値域条件を満たす増大作用素とする. $x_0 \in \bigcap_{r>0} R(I+rA)$ に対し, $\{x_n\}$ を (***) によつて定義される点列とすると

$$x_n / \sum_{i=0}^{n-1} r_i$$

は $-u$ に強収束する. ただし, u は $\overline{R(A)}$ の最小ノルムをもつ一意の元である.

証明の概略 点列

$$\{s_n\} = \left\{ x_0 - x_n / \sum_{i=0}^{n-1} r_i \right\}$$

は有界であり, E は回帰的な Banach 空間であるから, Banach limit μ に対して

$$f_n(s_n, x^*) = (u, x^*), \quad \forall x^* \in E^*$$

となる $u \in \overline{\text{co}}\{s_n\}$ が存在する。この u に対して

$$\|u\| = d(0, R(A))$$

が成り立つ。さらに E は strictly convex Banach 空間となるから、 $\{s_n\}$ の弱収束するような部分列の収束先は u と一致する。よって $\{s_n\}$ は u に弱収束する。さらに補助定理より $\|s_n\| \rightarrow \|u\| = d(0, R(A))$ であるから、Banach 空間 E の条件 (E^* は Fréchet 微分可能なノルムをもつ) を使えば、 $\{s_n\}$ は u に強収束するといふことがわかる。

さらにつぎの定理がいえる。

定理3 (Jung-Takahashi) E を Banach 空間とし、 $A \in E \times E$ を値域条件を満たす増大作用素とする。 $x_0 \in \bigcap_{r>0} R(I+rA)$ に対して、 $\{x_n\}$ を (***) によって定義される点列とすると

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{\|x_n - x_{n+1}\|}{r_n} = d(0, R(A)).$$

とくに、 $d(0, R(A)) = 0$, $r_n = 1$ とし、定理3を用いると

$$J_1^n x - J_1^{n+1} x \rightarrow 0$$

となる。 C を Banach 空間 E の閉凸集合とし、 T を C から C への nonexpansive 写像とすると、増大作用素 $A = I - T$ によってつくられるリゾルベント J_1 は、 C が有界という仮定の下では nonexpansive かつ asymptotically regular 写像になるといふこと

ある。 $F(T) = F(T)$ であるから、 T の不動点の問題は、より強い条件のついた T の不動点の問題となる。

増大作用素 A のリゾルベントの収束定理に関してはつぎの定理もある [24, p.125]。

定理4 E を一様凸で一様 Gateaux 微分可能なノルムを持つ Banach 空間とし、 $A \in E \times E$ を値域条件を満たす増大作用素とする。 C を E の空でない閉凸集合で

$$\overline{D(A)} \subset C \subset \bigcap_{r>0} R(I+rA)$$

を満たすものとする。このとき、 $0 \in R(A)$ ならば、任意の $x \in C$ に対して、 $\lim_{t \rightarrow \infty} T_t x$ が存在して、その極限は $A^{-1}0$ に属する。

この定理は Browder の強収束定理 [5] の拡張になっている。実際 C を Hilbert 空間の閉凸集合とし、 T を C から C への nonexpansive 写像で、 $F(T) \neq \emptyset$ となるものとする。 $x_0 \in C$ に対し

$$T_n x = \left(1 - \frac{1}{n}\right) T x + \frac{1}{n} x_0$$

で定義される写像 T_n は一意の不動点 u_n をもつ。増大作用素 $A = I - T$ に対して、 $T_{n+1} x_0 = u_n$ であるから、上の定理より

$$\lim_{n \rightarrow \infty} T_n x_0 = \lim_{n \rightarrow \infty} u_{n+1} \in A^{-1}0 = F(T)$$

となる。これで Browder の強収束定理が与えたことになる。

最後に nonexpansive 半群の非線形エルゴード定理について述べる。その前に定義を与えておく。

S を semitopological 半群 ($S = \{0, 1, 2, \dots\}$ や $S = [0, \infty)$ はその例である) とし, $B(S)$ を S 上の有界実数値関数のつくる Banach 空間とする。 X を恒等的に 1 となる関数 e を含む $B(S)$ の部分空間とする。 $\mu \in X^*$ が $\|\mu\| = 1 = \mu(e)$ を満たすとき, μ を X 上の mean とする。 $f \in B(S)$ と $a \in S$ に対し

$$(la f)(t) = f(at), \quad (ra f)(t) = f(ta)$$

で la, ra を定義し, $B(S)$ の部分空間 X は $la(X) \subset X, ra(X) \subset X$ を満たすものとする。このとき, X 上の means の net $\{\mu_\alpha\}$ が $f \in X$ と $a \in S$ に対し

$$\mu_\alpha(f) - \mu_\alpha(la f) \rightarrow 0, \quad \mu_\alpha(f) - \mu_\alpha(ra f) \rightarrow 0$$

を満たすとき, 漸近的に不変であるという。例えば,

$S = \{0, 1, 2, \dots\}$ とし, $x = (x_0, x_1, x_2, \dots) \in B(S)$ に対し

$$\mu_n(x) = \frac{1}{n} \sum_{k=0}^{n-1} x_k \quad (n=1, 2, 3, \dots)$$

とすると, $\{\mu_n\}$ は $B(S)$ 上の漸近的に不変な means の net である。 S 上の有界連続関数 f に対し, $a \mapsto ra f$ が連続となるような元 f の全体を $RUC(S)$ で表すと, $X = RUC(S)$ は e を含み, $la(X) \subset X, ra(X) \subset X$ となるような $B(S)$ の部分空間となる。

C を Hilbert 空間 H の閉部分集合とし, $\{T_t: t \in S\}$ を C 上の nonexpansive 半群とする. かつ $\sup_{s \in S} \|T_s x\| < +\infty$ とする. $RUC(S)$ 上の mean μ に対し, Riesz の定理によつて

$$\mu_t(T_t x, y) = (x_0, y), \quad \forall y \in H$$

となる $x_0 \in H$ が存在する. x に対し, この $x_0 \in T_\mu x = x_0$ を表すところの定理が成り立つ.

定理 5 C を Hilbert 空間 H の閉集合とする. $S = \{T_t: t \in S\}$ を C 上の nonexpansive 半群とし, $\{\mu_\alpha\}$ を $RUC(S)$ 上の漸近的に不変な means の net とする. さらに, C のある元 x に対し, $\{T_t x: t \in S\}$ は有界で, $\bigcap_{t \in S} \overline{\text{co}}\{T_{ts} x: s \in S\} \subset C$ とする. このとき, $\bigcap_{t \in S} F(T_t) \neq \emptyset$ であり, かつ $T_\mu x$ は $\bigcap_{t \in S} F(T_t)$ の元 x_0 に弱収束する.

この定理から Baillon によつて得られた非線形エルゴード定理はただちに得られる.

系 (Baillon) C を Hilbert 空間 H の閉凸集合とし, $S = \{S(t): t \in [0, \infty)\}$ を C 上の nonexpansive 半群とする. かつ, $\bigcap_{t \geq 0} F(S(t)) \neq \emptyset$ とする. このとき, 任意の $x \in C$ に対し

$$S_\lambda x = \frac{1}{\lambda} \int_0^\lambda S(t)x dt$$

は $\bigcap_{t \geq 0} F(S(t))$ の元 x_0 に弱収束する.

References

- [1] Baillon, J. B., Un théorème de type ergodic pour les contraction non linéaires dans un espace de Hilbert, C.R. Acad. Sci. Paris, 280 (1975), 1511-1514.
- [2] Baillon, J. B., Quelques propriétés de convergence asymptotique pour les semigroupes de contractions impaires, C.R. Acad. Sci. Paris, 283 (1976), 75-78.
- [3] Brezis, H and P. L. Lions, Product infinis de resolvents, Israel J. Math., 29 (1978), 329-345.
- [4] Browder, F. E., Nonexpansive nonlinear operators in a Banach space, Proc. Nat. Acad. Sci. USA, 54 (1965), 1041-1044.
- [5] Browder, F. E., Convergence of approximants to fixed points of nonexpansive nonlinear mappings in Banach spaces, Arch. Rat. Mech. Anal., 24 (1967), 82-90.
- [6] Browder, F. E., The fixed point theory of multi-valued mappings in topological vector spaces, Math. Ann., 177 (1968), 283-301.
- [7] Caristi, J., Fixed point theorems for mappings satisfying inwardness conditions, Trans. Amer. Math. Soc., 215 (1976), 241-251.
- [8] Day, M. M., Fixed point theorem for compact convex sets, Illinois J. Math., 5 (1961), 585-590.
- [9] Dunford, N. and J. T. Schwartz, Linear Operator, I, Interscience New York (1958).
- [10] Ekeland, I., Nonconvex minimization problems, Bull. Amer. Math. Soc., 1 (1979), 443-474.

- [11] Fan, K., Existence theorems and extreme solutions for inequalities concerning convex functions or linear transformations, *Math. Z.*, 68 (1957), 205-217.
- [12] Fan, K., Extensions of two fixed point theorems of F.E. Browder, *Math. Z.*, 112 (1969), 234-240.
- [13] Göhde, D., Über Fixpunkte bei stetigen Selbstabbildungen mit kompakten iterierten, *Math. Nachr.*, 27 (1964), 45-55.
- [14] Jung, J. S. and W. Takahashi, On the asymptotic behavior of infinite products of resolvents in Banach spaces, to appear.
- [15] Kirk, W.A., A fixed point theorem for mappings which do not increase distances, *Amer. Math. Monthly*, 72 (1965), 1004-1006.
- [16] 高村幸男, 小西芳雄, 非線型発展方程式, 岩波講座基礎数学, 岩波書店 (1977).
- [17] Lim, T.C., A fixed point theorem for multivalued nonexpansive mappings in a uniformly convex Banach space, *Bull. Amer. Math. Soc.*, 80 (1974), 1123-1126.
- [18] Markin, J.T., A fixed point theorem for set valued mappings, *Bull. Amer. Math. Soc.*, 74 (1968), 639-640.
- [19] Nadler, Jr. S. B., Multi-valued contraction mappings, *Pacific J. Math.*, 30 (1969), 475-488.
- [20] Pazy, A., Remarks on nonlinear ergodic theory in Hilbert space, *Nonlinear Analysis*, 3 (1979), 863-871.

- [21] Rockafellar, R.T., Monotone operators and the proximal point algorithm, SIAM J. Control and Optimization, 14 (1976), 897-898.
- [22] Takahashi, W., Fixed point theorems for families of nonexpansive mappings on unbounded sets, J. Math. Soc. Japan, 36 (1984), 543-553.
- [23] Takahashi, W., A nonlinear ergodic theorem for a reversible semigroup of nonexpansive mappings in a Hilbert space, Proc. Amer. Math. Soc., 96 (1986), 55-58.
- [24] 高橋 渉, 非線形関数解析学 - 不動点定理とその周辺 -, 近代科学社 (1988).
- [25] Takahashi, W., Existence theorems generalizing fixed point theorems for multivalued mappings, to appear in Proceedings of International Conference of Fixed Point Theory and Applications, 1989, Marseille.
- [26] Takahashi, W., Fixed point theorem and nonlinear ergodic theorem for nonexpansive semigroups without convexity, to appear in Canadian J. Math...