

УДК 528.063

ОСНОВЫ ЛИНЕАРИЗОВАННОГО МЕТОДА МНОГОКРИТЕРИАЛЬНОЙ ОПТИМИЗАЦИИ

канд. техн. наук **В.В. ЯЛТЫХОВ**, **Н.С. СЫРОВА**, **С.Г. ШНИТКО**
 (Полоцкий государственный университет),
 канд. техн. наук **П.М. ЛЕВДАНСКИЙ**
 (ООО «Легром», Минск)

В геодезической литературе неоднократно приводились примеры геодезических измерений, в результате анализа которых был установлен характер распределения ошибок, отличный от нормального. Поэтому при математической обработке результатов измерений имеет смысл сначала установить закон распределения ошибок по результатам измерений, а затем соответственно выбирать корректные методы уравнивания. В опубликованной литературе достаточно часто приводятся примеры неклассических способов уравнивания геодезических измерений. Одним из таких способов обработки измерений является метод L_p -оценок. Этот метод в рамках единого алгоритма обобщает метод наименьших квадратов ($n = 2$), метод наименьших модулей (МНМ) ($n = 1$), чебышевского минимакса ($n = \infty$) и ряд других, соответствующих значениям $1 < n < \infty$.

Недостаток метода L_p -оценок заключается в постоянстве показателя степени n для всех разнородных результатов измерений. Для того чтобы в полигонометрии для углов применить одну степень, а для сторон – другую, предлагается многостепенная целевая функция. Формула для веса результатов измерений в многостепенном случае получена согласно исследованиям С.Д. Волжанина, И.В. Джуня, Ю.И. Маркузе и др. Минимизацию критериальной функции ранее осуществляли нелинейным методом Ньютона, хотя возможно применение других методов нелинейного программирования. Если степени n_i определены не средствами математической статистики, а под условием минимума максимальной ошибки положения пункта в слабом месте, то получим многокритериальную оптимизацию, так как в поиске решения участвуют два критерия. Чтобы воспользоваться этой формулой, необходимо уметь выполнять оценку точности результатов уравнивания при различных n .

В статье предложены основные формулы параметрического и коррелятного метода многокритериальной оптимизации.

Введение. В теории ошибок результатов измерений рассматривается вопрос математической обработки многократных наблюдений одной и той же величины. Эта задача является частным случаем совместной обработки совокупности результатов измерений многих величин, например, длин сторон и углов в плановых сетях или превышений в нивелирных построениях.

Оценки метода наименьших квадратов (МНК) оптимальны в классе всех линейных несмещенных оценок, только если ошибки результатов измерений подчинены нормальному закону распределения. Эффективность оценок МНК резко падает даже при небольших отклонениях от нормальности.

Если в целевой функции используется только одно значение степени n , устанавливаемое в зависимости от закона распределения погрешностей результатов измерений, то имеем известный метод L_p -оценок. Но на практике на одном геодезическом объекте часто встречаются разнородные измерения, например, при развитии линейно-угловых сетей. В этих случаях требуется до уравнивания определить и использовать разные степени n для каждой группы измерений. Очевидно, что алгоритм минимизации многостепенной целевой функции не должен зависеть от количества групп измерений со степенями n_i , включая предельный случай N групп (для каждого из N измерений своя степень). При этом чем меньше количество результатов измерений в группе, тем меньше надежность установления n , которые в таких случаях могут выбираться априорно или другим путем – на основе метода многостепенной многокритериальной оптимизации под условием минимума дополнительного критерия.

В процессе многокритериальной оптимизации используется векторный, а не один скалярный показатель эффективности решения. В геодезической практике этот новый подход может применяться не взамен прежним технологиям, а в дополнение к ним. Ниже показано, что несколько критериев оптимальности решения можно применять не только в алгоритмах уравнивания L_p -оценок, но и в рамках метода наименьших квадратов при проектировании оптимального плана наблюдений и в математической обработке результатов геодезических измерений [1].

Вывод формулы для вычисления весов результатов измерений при многостепенной оптимизации. В случае многостепенной оптимизации в [2] предлагается использовать целевую функцию

$$\Phi(X) = \sum_{i=1}^N P_i |L_i(X)|^{n_i}, \quad (1)$$

где N – количество результатов измерений; P – веса результатов измерений, вычисляемые по формуле: $P_i = c/\sigma_i^{n_i}$; $L(X)$ – свободный член нелинейного параметрического уравнения; n – показатель степени.

Для минимизации функции (1) применим метод Ньютона:

$$X^{(j+1)} = X^{(j)} - H^{-1}(X^{(j)}) \nabla \Phi(X^{(j)}), \quad (2)$$

где $H(X^{(j)})$ – матрица Гессе вторых частных производных целевой функции по параметрам; $\nabla \Phi(X^{(j)})$ – градиент целевой функции; j – номер итерации.

Найдем аналитические выражения для этих матриц применительно к целевой функции (1). В дальнейшем будем дифференцировать функцию вида $y = |X|^n$, применяя формулу: $y' = n \cdot \text{Sign}(X) |X|^{n-1}$, где $\text{Sign}(X)$ – функция передачи знака (или единица со знаком переменной X).

Чтобы найти $\partial \Phi / \partial x$ запишем равенство (1) в виде:

$$\Phi(X) = P_1 |L_1(X)|^{n_1} + P_2 |L_2(X)|^{n_2} + \dots + P_N |L_N(X)|^{n_N}, \quad (3)$$

Следовательно, при $X = [X_1, X_2, \dots, X_i]^T$

$$\frac{\partial \Phi}{\partial X_1} = n_1 \text{Sign}(L_1) |L_1(X)|^{n_1-1} a_{11} P_1 + n_2 \text{Sign}(L_2) |L_2(X)|^{n_2-1} a_{21} P_2 + \dots + n_N \text{Sign}(L_N) |L_N(X)|^{n_N-1} a_{N1} P_N, \quad (4)$$

где $a_{ij} = \partial L_i(X) / \partial x_j$ – коэффициенты параметрических уравнений поправок.

Отсюда градиент целевой функции

$$\nabla \Phi(X) = \begin{bmatrix} \frac{\partial \Phi}{\partial X_1} \\ \frac{\partial \Phi}{\partial X_2} \\ \vdots \\ \frac{\partial \Phi}{\partial X_i} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \sum_{i=1}^N n_i S_i |L_i(X)|^{n_i-1} a_{i1} P_i \\ \sum_{i=1}^N n_i S_i |L_i(X)|^{n_i-1} a_{i2} P_i \\ \dots \\ \sum_{i=1}^N n_i S_i |L_i(X)|^{n_i-1} a_{in} P_i \end{bmatrix}, \quad (5)$$

где $S_i = \text{Sign}(L_i)$.

Выражение (5) можно записать в матричном виде:

$$\nabla \Phi(X) = A^T K L(X), \quad (6)$$

где $K = \text{diag}(K_i)$,

$$K_i = n_i P_i |L_i(X)|^{n_i-2}. \quad (7)$$

В этом равенстве применена степень $n = 2$, поскольку для всех $L_i(X) \neq 0$

$$\frac{\text{Sign}(L_i) |L_i(X)|^{n_i-1}}{L_i(X)} = |L_i(X)|^{n_i-2}. \quad (8)$$

Найдем вторые производные от целевой функции, дифференцируя (4);

$$\begin{aligned} \frac{\partial^2 \Phi}{\partial X_1^2} = & n_1(n_1-1) \text{Sign}(L_1) \text{Sign}(L_1) |L_1(X)|^{n_1-2} a_{11} \cdot a_{11} P_1 + n_2(n_2-1) \text{Sign}(L_2) \text{Sign}(L_2) |L_2(X)|^{n_2-2} a_{21} \cdot a_{21} P_2 + \dots \\ & \dots + n_N(n_N-1) \text{Sign}(L_N) \text{Sign}(L_N) |L_N(X)|^{n_N-2} a_{N1} \cdot a_{N1} P_N; \end{aligned} \quad (9)$$

$$\frac{\partial^2 \Phi}{\partial X_1^2} = n_1(n_1-1) |L_1(X)|^{n_1-2} a_{11}^2 P_1 + n_2(n_2-1) |L_2(X)|^{n_2-2} a_{21}^2 P_2 + \dots$$

$$\dots + n_N(n_N-1) |L_N(X)|^{n_N-2} a_{N1}^2 P_N = \sum_{i=1}^N n_i(n_i-1) |L_i(X)|^{n_i-2} a_{i1}^2 P_i.$$

Найдем

$$\begin{aligned} \frac{\partial^2 \Phi}{\partial X_1 \partial X_i} &= n_1(n_1 - 1) |L_1(X)|^{n_1 - 2} a_{11} a_{1i} P_1 + \dots + n_N(n_N - 1) |L_N(X)|^{n_N - 2} a_{N1} a_{Ni} P_N = \\ &= \sum_{i=1}^N n_i(n_i - 1) |L_i(X)|^{n_i - 2} a_{i1} a_{ii} P_i. \end{aligned} \quad (10)$$

Отсюда

$$H(X) = A^T C A, \quad (11)$$

где

$$C = \text{diag}(C_i).$$

Здесь

$$C_i = n_i(n_i - 1) P_i |L_i(X)|^{n_i - 2}. \quad (12)$$

Таким образом, для целевой функции (1) вместо (2) получим:

$$X^{(j+1)} = X^{(j)} - (A^T C A)^{-1} A^T K L(X), \quad (13)$$

или

$$X^{(j+1)} = X^{(j)} - (A^T C A)^{-1} A^T \text{diag}\left(\frac{1}{n_i - 1}\right) C L(X). \quad (14)$$

Матрица C является весовой матрицей при многостепенной оптимизации, а формула (14) позволяет выполнять эту оптимизацию аналитически.

Поиск управляющей целевой функции при использовании многокритериального параметрического способа уравнивания. Как известно, в методе многокритериальной оптимизации (МК) используется две целевых функции [2]:

$$\Phi_1(X) = \sum_{i=1}^N \frac{1}{m_i^{n_i}} |L_i(X)|^{n_i}, \quad (15)$$

$$\Phi_2(X, n) = \min \max M_K, \quad (16)$$

или

$$\Phi_2(X, n) = \min \sum M^2,$$

или

$$\Phi_2(X, n) = \min \max M \cdot \mu$$

в которых N – число измеренных величин; m – С.К.О. измерения, полученная по МНК; n – показатель степени, отыскиваемый в процессе итераций; $L(X) = T^{\text{ввч.}} - T^{\text{изм.}}$ – свободный член измерения; $M_K = \mu \sqrt{Q_{K,K} + Q_{K+1,K+1}}$ – ошибка положения пункта;

$$\mu_{\text{МК}} = \sqrt{\frac{V_{\text{МК}}^T \text{diag}\left(\frac{1}{m_i}\right)^{n_i} V_{\text{МК}}}{r}}, \quad (17)$$

$$V_{\text{МК}} = T_{\text{МК}}^{\text{управ}} - T^{\text{изм}}, \quad (18)$$

r – количество избыточных измерений.

Минимум функции (15) находят как нелинейным, так и линейным методом:

$$X_{\text{МК}}^{(j+1)} = X_{\text{МК}}^{(j)} - \left(A^T C A \right)^{-1} A^T \text{diag}\left(\frac{1}{n_i - 1}\right) C L(X^{(j)}), \quad (19)$$

или

$$\delta X^{(j)} = -F \text{diag}\left(\frac{1}{n_i - 1}\right) L(X^{(j)}), \quad (20)$$

$$C_i = n_i (n_i - 1) \text{diag} \left(\frac{1}{m_i} \right)^{n_i} (|V_i(X)| + 10^{-6})^{n_i - 2}, \tag{21}$$

а обратная матрица весов

$$Q = F \text{diag} (m_i^{n_i}) F^T \tag{22}$$

используется при оценке точности функций измеренных и уравненных величин, включая М.
В статье приводятся значения

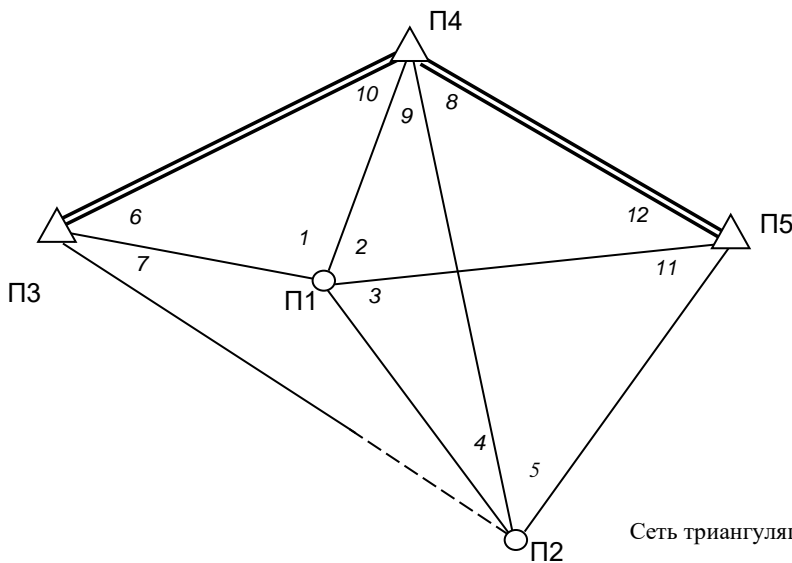
$$\mu_{\text{МНК}} = \sqrt{\frac{V_{\text{МНК}}^T \text{diag} \left(\frac{1}{\sigma_i} \right)^2 V_{\text{МНК}}}{r}}; \tag{23}$$

$\mu_{\text{МК}}$, вычисленные по формуле (17) и ошибки положения, из равенства (22) для МК и выражений:

$$Q = \left(A^T \text{diag} \left(\frac{1}{\sigma_i} \right)^2 A \right)^{-1}, \tag{24}$$

$$X_{\text{МНК}}^{(j+1)} = X_{\text{МНК}}^{(j)} - F_{\text{МНК}} L_{\text{МНК}}; F_{\text{МНК}} = Q A^T P; \tag{25}$$

для МНК. В формулах (19) и (24) A – матрица коэффициентов параметрических уравнений поправок.



Сеть триангуляции из [3, с. 160]

Метод МК особенно эффективен при обработке линейно-угловых сетей с завышенным значением числа обусловленности матрицы R с использованием $Q = R^{-1}$.

В таблице 1 приведены расчеты по многокритериальной оптимизации с различными тремя управляющими целевыми функциями (16) для сети триангуляции, приведенной на рисунке. По результатам уравнивания видно, что возможно применение первой из трех управляющих функций.

Таблица 1

Обработка триангуляции из [3, с. 160]

| Обозначения | $n = 2,0$ | $\Phi_2(X, n) = \min \max M$ | | $\Phi_2(X, n) = \min \sum_{i=1}^k M^2$ | | $\Phi_2(X, n) = \min \max M \cdot \mu$ | |
|-------------|-----------|------------------------------|---------|--|---------|--|---------|
| | | n | данные | n | данные | n | данные |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| μ | 0,980 | | 0,957 | | 0,963 | | 0,960 |
| M_1 | 0,080 м | | 0,075 м | | 0,073 м | | 0,078 м |
| M_2 | 0,102 | | 0,090 | | 0,090 | | 0,093 |
| V_1 | 1,14" | 2,08 | 1,30" | 1,96 | 1,40" | 2,08 | 1,34" |
| V_2 | 0,94 | 1,95 | 0,92 | 1,88 | 0,89 | 1,80 | 0,90 |

Окончание таблицы 1

| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
|----------|-------|------|-------|------|-------|------|-------|
| V_3 | -0,70 | 1,84 | -0,72 | 1,94 | -0,79 | 1,80 | -1,02 |
| V_4 | 1,31 | 2,28 | 1,29 | 2,13 | 1,35 | 2,00 | 1,54 |
| V_5 | -3,13 | 2,06 | -3,15 | 2,06 | -3,12 | 2,11 | -3,05 |
| V_6 | 0,15 | 1,26 | 0,10 | 1,24 | 0,11 | 1,57 | 0,25 |
| V_7 | -0,55 | 2,15 | -0,62 | 1,94 | -0,66 | 2,00 | -0,63 |
| V_8 | 1,23 | 1,81 | 1,25 | 1,85 | 1,26 | 1,86 | 1,21 |
| V_9 | -3,29 | 2,15 | -3,22 | 2,16 | -3,17 | 2,20 | -3,15 |
| V_{10} | 0,22 | 1,40 | 0,13 | 1,15 | 0,07 | 2,00 | 0,10 |
| V_{11} | 0,05 | 1,27 | 0,12 | 1,26 | 0,11 | 1,19 | 0,07 |
| V_{12} | 0,48 | 1,59 | 0,41 | 1,59 | 0,38 | 1,60 | 0,40 |

Анализ управляющей целевой функции при уравнивании геодезических измерений многокритериальным коррелятным способом. При уравнивании некоррелированных результатов измерений по МНК коррелятным способом применяют следующие известные формулы:

- для вектора поправок в результаты измерений:

$$V = -P^{-1}B^T (BP^{-1}B^T)^{-1}W ; \quad (26)$$

- для СКП единицы веса:

$$\mu = \sqrt{\frac{V^T P V}{N-t}} , \quad (27)$$

где $B_{r \times N}$ – матрица коэффициентов условных уравнений ($r = N - t$ – число избыточных измерений); $P_{N \times N}$ – диагональная матрица весов результатов измерений; $W_{r \times 1}$ – вектор свободных членов условных уравнений; N – количество результатов измерений; t – число необходимых измерений.

Чтобы перейти от B^* к B на ПК, устанавливают в геодезической сети в произвольном порядке необходимые измерения, а коэффициенты уравнений для оставшихся r избыточных измерений выделяют по строкам из $B_{N \times N}^*$ и записывают их в $B_{r \times N}$.

Идемпотентная матрица B^* имеет свойство: $B^* = B^* \cdot B^* \cdot \dots \cdot B^*$, характеризуется тем, что нужно с особой тщательностью находить её строки и записывать их в B так, чтобы эти строки были независимыми. Это составляет определённые трудности, которые можно избежать, опираясь на рекуррентный способ уравнивания параметрическим способом. Оказывается, в этом способе коэффициент

$$q_i = \frac{1}{p_i} + a_i z_i^T ; \quad z_i^T = Q_{i-1} \cdot a_i^T \quad (28)$$

принимает максимальные значения для необходимых измерений. Поэтому выстраиваем значения q_i вместе с номерами измерений i в порядке убывания q_i . Последние r строк из номеров измерений будут соответствовать номерам избыточных измерений.

Но согласно формуле (26), должен быть известен вектор W . В автоматизированном способе он будет таким:

$$W_{r \times 1} = (-V_{N \times 1})_{\text{выделенное}} , \quad (29)$$

записываемое для r избыточных измерений. При этом

$$V_{N \times 1} = (E - AF) \cdot L_{N \times 1} = B_{N \times N}^* \cdot L_{N \times 1} , \quad (30)$$

где L – вектор свободных членов параметрических уравнений поправок, соответствующий произвольному по точности вектору X^0 .

В статье приводятся значения:

$$\mu_{\text{МНК}} = \sqrt{\frac{V_{\text{МНК}}^T \text{diag} \left(\frac{1}{\sigma_i} \right)^2 V_{\text{МНК}}}{r}}; \quad (31)$$

$\mu_{\text{МК}}$, вычисленные по формуле (17) и ошибки положения, из равенства (29) для МК и выражений:

$$Q = \left(A^T \text{diag} \left(\frac{1}{\sigma_i} \right)^2 A \right)^{-1}; \quad (32)$$

$$X_{\text{МНК}}^{(j+1)} = X_{\text{МНК}}^{(j)} - F_{\text{МНК}} L_{\text{МНК}}; \quad F_{\text{МНК}} = Q A^T P, \quad (33)$$

для МНК. В формулах (26) и (31) A – матрица коэффициентов параметрических уравнений поправок.

Алгоритм многокритериального коррелятного уравнивания заключается в следующем [2].

При коррелятном способе уравнивания для многокритериальной оптимизации сначала находят матрицу коэффициентов условных уравнений:

$$B_{N \times N}^* = E_{N \times N} - A_{N \times r} F_{r \times N}^*, \quad (34)$$

выделяя из B^* r строк для избыточных измерений, где

$$F^* = (A^T P_{n=2,0} A)^{-1} A^T P_{n=2,0}, \quad (35)$$

а

$$W_{r \times 1} = - (B_{N \times N}^* L_{N \times 1})_{\text{выделенное}}. \quad (36)$$

Здесь $L = L(X)_{n=2,0}$.

Далее вычисляют вектор поправок в результаты измерений из j -той итерации:

$$(V_{N \times 1})_j = - (P_{n_j}^{-1})_{N \times N} B_{N \times r}^T (K_{n_j})_{r \times 1}, \quad (37)$$

где

$$K_{n_j} = - (B C_j^{-1} B^T)^{-1} W, \quad (38)$$

в которой

$$C_j = \text{diag} (C_i)_{N \times N}, \quad (39)$$

а C_i находят по формуле:

$$C_i = n_i (n_i - 1) (P_{n_i})_j |V_i|_j^{n_i}, \quad (40)$$

аналогичной формуле:

$$C_i = n_i (n_i - 1) P_{n_i} |L_i(X)|^{n_i}. \quad (41)$$

Величину $|V_i|_j$ получают из равенства (37) для K_{n_j} и для P_{n_i} , найденного по формуле [4]:

$$P_{n_i} = \left(\frac{1}{m_i} \right)^{n_i}. \quad (42)$$

Оценку точности в коррелятном способе выполняют по формулам:

$$m_i = \mu' \sqrt{\left(\frac{1}{P_f} \right)_i}; \quad (43)$$

$$M_k = \sqrt{m_i^2 + m_{i+1}^2}; \quad (44)$$

$$\left(\frac{1}{P_f} \right)_i = f_i \left(P_{N \times N}^{-1} - P_{N \times N}^{-1} B_{N \times r}^T \left(B_{r \times N} P_{N \times N}^{-1} B_{N \times r}^T \right)^{-1} B_{r \times N} P_{N \times N}^{-1} \right) f_i^T, \quad (45)$$

а вектор-строку для функции получают так:

$$f_i = F_{i \times N}^*. \quad (46)$$

Степени n_i находят методом проб и ошибок с шагом 0,1 для N измерений, что составляет одно приближение. Количество итераций $j \leq 20$.

Линеаризованный вариант коррелятного многокритериального способа включает минимизацию следующих целевых функций: (15), (16) (табл. 2).

Таблица 2

Обработка примера (триангуляция из [3, с. 160])

| Обозначения | v при $n = 2,0$ | Коррелятный способ | | | |
|-------------|-------------------|----------------------------|---------|--------------------------------------|---------|
| | | $\Phi_2 = (X, n) = \max M$ | | $\Phi_2 = (X, n) = \max M \cdot \mu$ | |
| | | n | v | n | v |
| μ | 1,000 | | 0,890 | | 0,767 |
| M_1 | 0,082 м | | 0,073 м | | 0,068 м |
| M_2 | 0,104 | | 0,086 | | 0,084 |
| V_1 | 1,14" | 2,60 | 1,51" | 2,94 | 1,70" |
| V_2 | 0,94 | 2,30 | 1,16 | 2,96 | 1,20 |
| V_3 | -0,70 | 1,80 | -1,19 | 2,73 | -1,39 |
| V_4 | 1,31 | 2,90 | 1,49 | 3,00 | 1,55 |
| V_5 | -3,13 | 2,50 | -2,84 | 2,97 | -2,81 |
| V_6 | 0,15 | 1,20 | 0,48 | 1,63 | 0,54 |
| V_7 | -0,55 | 2,70 | -0,83 | 3,00 | -0,94 |
| V_8 | 1,23 | 1,70 | 1,22 | 3,00 | 1,19 |
| V_9 | -3,45 | 2,50 | -3,35 | 2,98 | -3,25 |
| V_{10} | 0,12 | 1,20 | 0,03 | 1,19 | -0,05 |
| V_{11} | 0,08 | 1,20 | 0,10 | 1,11 | 0,22 |
| V_{12} | 0,50 | 1,20 | 0,20 | 1,11 | 0,08 |

На основе данных таблиц 1 и 2 можно сделать следующие **выводы**:

1. Условия (15) и (16) по сравнению с МНК всегда приводят к меньшим величинам M .
2. Наибольший эффект уменьшения M достигается для линейно-угловых сетей и построений триангуляции. Уменьшение M по сравнению с МНК иногда составляет 250 % (2,5 раза).
3. Применение условий (15) и (16) практически равноценно, но мы предпочтение отдаем функции (16).

ЛИТЕРАТУРА

1. Маркузе, Ю.И. Геодезия. Вычисление и уравнивание геодезических сетей / Ю.И. Маркузе, Е.Г. Бойко, В.В. Голубев. – М.: Картгеоцентр – Геодезиздат, 1994. – 431 с.
2. Применение многокритериальной оптимизации при проектировании и уравнивании геодезических сетей / В.И. Мицкевич [и др.] // Вестн. Полоцк. гос. ун-та. Сер. С. Фундаментальные науки. – 2004. – № 4. – С. 77 – 79.
3. Рабинович, Б.Н. Практикум по высшей геодезии / Б.Н. Рабинович. – М.: Геодезиздат, 1961. – 339 с.
4. Шнитко, С.Г. Сравнение методик назначения весов результатов измерений при многокритериальном уравнивании / С.Г. Шнитко // Вестн. Полоцк. гос. ун-та. Сер. В. Прикладные науки. – 2005. – № 9. – С. 53 – 55.

Поступила 15.07.2007