

Ottimizzazione vettoriale

Appunti a cura di
Fioravante PATRONE

Indice

1	Preludio e motivazioni (matematiche)	2
2	Astratto fa bene	3
3	Ottimizzazione vettoriale	6
4	Ottimi paretiani deboli e forti	8
5	Scalarizzazione	10
6	Ottimizzazione e teoria delle decisioni	13
7	Appendice: preordini e loro aggregazione	15

1 Preludio e motivazioni (matematiche)

La comprensione dei concetti fondamentali dell'ottimizzazione vettoriale richiede che essi siano inquadrati in un contesto appropriato. Premessa indispensabile è la revisione e riflessione su cosa significhi ottimizzazione nel caso “standard”, ovvero quando si è interessati al massimo o ai punti di massimo di una funzione a valori reali.

Ricordo che normalmente si dice che, dato un insieme e data $f : X \rightarrow \mathbb{R}$, un punto $\bar{x} \in X$ è *punto di massimo*¹ per f se $f(\bar{x}) \geq f(x)$ per ogni $x \in X$. Ovviamente, $f(\bar{x})$ viene detto *massimo* di f . Più in generale, dato $Y \subseteq X$, si dice che $\bar{x} \in Y$ è punto di massimo per f su Y se si ha $f(\bar{x}) \geq f(x)$ per ogni $x \in Y$.

Queste sono le definizioni che si incontrano normalmente. Se però vogliamo provare ad estendere la problematica della ricerca del massimo al caso “vettoriale”, ovvero quando abbiamo $f : X \rightarrow \mathbb{R}^n$, ci dobbiamo chiedere quale sia la strada più opportuna da seguire per effettuare questa generalizzazione. Di fatto sono disponibili *due* punti di vista, fra i quali ne privilegerò uno, lasciando ad una appendice la trattazione dell'altra linea di pensiero (essa stessa di notevole interesse, sia chiaro!).

Allora *riformuleremo* il problema e la definizione di massimo, per potere effettuare l'estensione al caso vettoriale. L'idea vincente è partire da $f(X)$, l'*immagine* di f ed osservare che $f(X)$ è un sottoinsieme di un insieme ordinato, \mathbb{R} . Ciò ci permette di ribaltare l'approccio usato per la definizione di massimo che abbiamo visto: diremo dapprima chi è il massimo di f e da ciò dedurremo cosa sia un punto di massimo.

Definizione 1 Sia $f : X \rightarrow \mathbb{R}$. Diremo che $\bar{t} \in f(X)$ è massimo per f se $\bar{t} \geq t$ per ogni $t \in f(X)$. Diremo che $\bar{x} \in X$ è un punto di massimo per f se $f(\bar{x}) = \bar{t}$, dove \bar{t} è massimo per f .

Come dovrebbe essere evidente, sfruttiamo il fatto che su $f(X)$ è a disposizione l'ordine \geq che $f(X)$ “eredita” da \mathbb{R} in quanto suo sottoinsieme.

Vediamo un interessante risultato, ben noto, sul quale avremo occasione di riflettere in seguito.

Proposizione 1 Sia data $f : X \rightarrow \mathbb{R}$. Il massimo per f , se esiste, è unico.

Dimostrazione

Siano \bar{t}_1 e \bar{t}_2 due massimi per f . Dimostriamo che coincidono.

¹Osservo che si sta parlando di massimo *globale* (o *assoluto* che dir si voglia). Non spenderò parole sui massimi *locali* (o *relativi* che dir si voglia). Aggiungo che non parlerò neanche di *minimi*, visto che basta “rovesciare” le disuguaglianze usate per i massimi.

Prima di tutto, ricordiamo cosa vuol dire che sono massimi:

$$\bar{t}_1 \geq t \quad \forall t \in f(X)$$

$$\bar{t}_2 \geq t \quad \forall t \in f(X)$$

Se prendiamo $t = \bar{t}_2$ nella prima proposizione e $t = \bar{t}_1$ nella seconda, otteniamo:

$$\bar{t}_1 \geq \bar{t}_2 \text{ e } \bar{t}_2 \geq \bar{t}_1$$

da qui, possiamo utilizzare la proprietà *antisimmetrica* del \geq su \mathbb{R} :

$$[\bar{t}_1 \geq \bar{t}_2 \text{ e } \bar{t}_2 \geq \bar{t}_1] \Rightarrow \bar{t}_1 = \bar{t}_2$$

Come volevasi dimostrare. □

Con ciò si chiude il prelude. Nel prossimo paragrafo introdurremo gli strumenti utili per la riformulazione richiesta, generalizzando questo approccio. Ma, prima, una osservazione.

Osservazione 1 *Si noti che il teorema di Weierstrass può essere “letto” come un teorema il quale garantisce che una funzione f , definita e continua su un intervallo $[a, b]$ di \mathbb{R} , è tale per cui la sua immagine $f([a, b])$ è un sottoinsieme di \mathbb{R} che ha massimo. Questo modo, a prima vista poco ortodosso, di “leggere” il teorema di Weierstrass, ne coglie invece il risultato essenziale, ovvero quello suscettibile delle più ampie generalizzazioni (è riconducibile al concetto di compattezza, che è un concetto fondamentale in topologia).*

2 Astratto fa bene

Sia A un insieme, su cui è definito un *preordine*² \succeq .

Dato B , con $B \subseteq A$, si osservi che B “eredita”³ la relazione \succeq definita su A .

Allora abbiamo la seguente:

²Ricordo che un preordine è una relazione riflessiva e transitiva. Un preordine \succeq è *totale* se la relazione \succeq è totale. Un preordine che sia anche *antisimmetrico* viene detto *ordine*; se è anche totale, lo chiameremo *ordine totale*.

³“Eredita” è un termine tecnico che si utilizza laddove una struttura matematica, definita su un insieme A , viene “passata” in modo “canonico” ad un sottoinsieme B . Nel nostro caso, il passaggio è del tutto ovvio. Riporto per completezza (o per pedanteria?) ciò che si intende. Dato un insieme A su cui sia definito un preordine, che indicheremo col simbolo \succeq_A , e dato $B \subseteq A$, definiamo una relazione \succeq_B su B nel modo seguente: dati $b_1, b_2 \in B$, diremo che $b_1 \succeq_B b_2$ se $b_1 \succeq_A b_2$. E’ immediato verificare che \succeq_B è un preordine, così come che è totale se \succeq_A lo è, e idem dicasi per l’antisimmetria. Data la situazione, non essendovi alcun rischio di confusione od errore, userò lo stesso simbolo, \succeq , per indicare il preordine sia su A che su B .

Definizione 2 Dato un insieme A ed un preordine \succeq su A e dato B , con $B \subseteq A$, diremo che $\bar{b} \in B$ è massimo per B se $\bar{b} \succeq b$ per ogni $b \in B$.

Osservazione 2 Non vi è alcuna garanzia, al solito, che il massimo esista. Ciò che è più interessante è che non c'è neanche alcuna garanzia che il massimo sia unico, per un preordine. Non possiamo adattare la dimostrazione fatta per l'unicità del massimo di f in quanto, per un preordine, non abbiamo a disposizione l'antisimmetria.

Esercizio 1 Mostrare un esempio di insieme finito A ed un preordine \succeq su A che abbia massimo su A ed uno che invece non ce l'abbia. Analogamente, mostrare un esempio in cui il massimo è unico ed uno in cui non lo è.

Proposizione 2 Dato un insieme A ed un ordine (cioè un preordine che è anche antisimmetrico) \succeq su A e dato B , con $B \subseteq A$, il massimo per \succeq su B , se esiste, è unico.

Dimostrazione

Basta adattare (quasi ricopiare) la dimostrazione vista per l'unicità del massimo per una funzione. Siano \bar{b}_1 e \bar{b}_2 due massimi per \succeq su B . Dimostriamo che coincidono.

Prima di tutto, ricordiamo cosa vuol dire che sono massimi:

$$\bar{b}_1 \succeq b \quad \forall b \in B$$

$$\bar{b}_2 \succeq b \quad \forall b \in B$$

Se prendiamo $b = \bar{b}_2$ nella prima proposizione e $b = \bar{b}_1$ nella seconda, otteniamo:

$$\bar{b}_1 \succeq \bar{b}_2 \text{ e } \bar{b}_2 \succeq \bar{b}_1$$

da qui, possiamo utilizzare la proprietà *antisimmetrica* di \succeq su B :

$$[\bar{b}_1 \succeq \bar{b}_2 \text{ e } \bar{b}_2 \succeq \bar{b}_1] \Rightarrow \bar{b}_1 = \bar{b}_2$$

Come volevasi dimostrare. □

Si noti che, se non richiediamo che il preordine sia totale, è sufficiente che vi sia anche un solo $b \in B$ che non sia confrontabile con \bar{b} affinché \bar{b} non sia massimo. Sarà quindi utile introdurre la definizione di un nuovo concetto, che tenga conto di questa osservazione.

Esercizio 2 Dimostrare che su un insieme finito un preordine totale ha sempre massimo.

Definizione 3 Dato A e dato \succeq , preordine su A , e dato B con $B \subseteq A$, $\bar{b} \in B$ è massimale per \succeq su B se $\bar{b} \succeq b \quad \forall b \in B$ che sia confrontabile con \bar{b} .

Osservazione 3 Anche qui, va da sé, non vi è alcuna garanzia che esista un elemento massimale. Visto che la definizione è stata data per un preordine, non abbiamo neanche la garanzia che, se esiste un elemento massimale, esso sia unico. Contrariamente a quello che succedeva per i massimi, questa volta neanche l'aggiunta della condizione di antisimmetria è sufficiente per garantire l'unicità di un elemento massimale. Ovviamente si possono fare esempi in cui l'unicità manca, ma può essere utile vedere dove “salta” la dimostrazione dell'unicità. Il passo che non riusciamo a compiere è quello in cui prendevamo come b una volta b_2 e l'altra volta b_1 . Questo era lecito, in quanto avevamo:

$$\bar{b}_1 \succeq b \quad \forall b \in B$$

$$\bar{b}_2 \succeq b \quad \forall b \in B$$

Ora invece sappiamo solo che:

$$\bar{b}_1 \succeq b \quad \forall b \in B \text{ confrontabile con } b_1$$

$$\bar{b}_2 \succeq b \quad \forall b \in B \text{ confrontabile con } b_2$$

E non abbiamo nessuna garanzia che b_2 sia confrontabile con b_1 (o viceversa).

Esercizio 3 Provare che su un insieme finito un preordine ha sempre elemento massimale.

Suggerimento

Prendiamo un elemento qualsiasi dell'insieme. Se non è confrontabile con nessun altro, è massimale. SE è confrontabile, facciamo un confronto e ci teniamo il migliore. E così via, fino ad avere esaurito tutti gli elementi dell'insieme. La transitività ci garantisce che non ci mettiamo a girare in tondo ...

Ora che abbiamo visto il quadro “astratto”, passiamo ad affrontare il problema che ci sta a cuore (sto esagerando!).

3 Ottimizzazione vettoriale

Abbiamo data una $F : X \rightarrow \mathbb{R}^n$ e ci interessa trovare i suoi “ottimi paretiani”. Cosa vuol dire? Lo vedremo subito. Ma prima una nota: mi occuperò del caso di una funzione a valori in \mathbb{R}^2 , anziché del caso generale, per avere il vantaggio di alleggerire le notazioni, senza che si vada a perdere alcunché di essenziale.

Dalla discussione vista prima, dovrebbe essere evidente che affronteremo il problema a partire dalla immagine di F . Pertanto, innanzi tutto definiamo un ordine su \mathbb{R}^2 .

Definizione 4 *Definiamo la relazione \geq su \mathbb{R}^2 nel modo seguente. Dati $t_1, t_2 \in \mathbb{R}^2$, con $t_1 = (x_1, y_1)$ e $t_2 = (x_2, y_2)$, diciamo che:*

$$t_1 \geq t_2 \quad \text{se} \quad x_1 \geq x_2 \text{ e } y_1 \geq y_2$$

Ci saranno utili anche le relazioni $>$ e \gg , così definite:

$$t_1 > t_2 \quad \text{se} \quad t_1 \geq t_2 \text{ e } t_1 \neq t_2$$

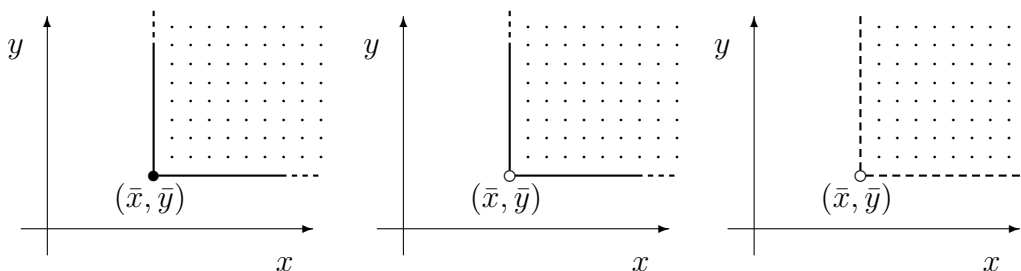
$$t_1 \gg t_2 \quad \text{se} \quad x_1 > x_2 \text{ e } y_1 > y_2$$

Vanno fatte varie considerazioni e precisazioni, sulla definizione appena data. Intanto, per la relazione \geq su \mathbb{R}^2 è stato utilizzato lo stesso simbolo usato per il \geq su \mathbb{R} . Non c'è rischio di confusione, visto che queste due relazioni sono definite su insiemi del tutto diversi. Altra considerazione riguarda i simboli che ho usato per le tre relazioni che ho appena definito: non c'è una notazione unificata, in questo contesto. Quindi, fare attenzione, nel leggere un testo che parla di queste relazioni (e, per esteso, di ottimizzazione vettoriale), a come sono definiti i simboli che vengono usati.

Si può agevolmente dimostrare la seguente:

Proposizione 3 *La relazione \geq su \mathbb{R}^2 è riflessiva, antisimmetrica e transitiva (pertanto è un ordine); non è totale. Le relazioni $>$ e \gg su \mathbb{R}^2 sono irreflessive, antisimmetriche e transitive (una relazione che goda di queste proprietà viene detta “ordine stretto”); non sono totali.*

Graficamente è facile rappresentare queste relazioni. Le figure seguenti dovrebbero essere sufficientemente esplicative.

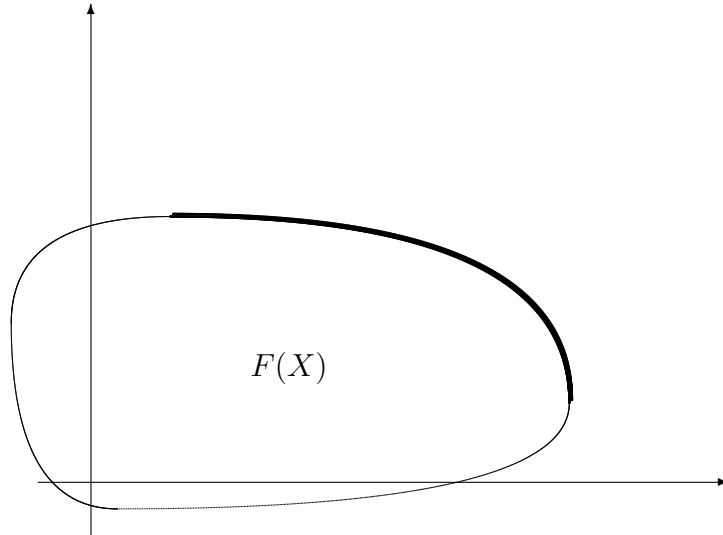


La zona punteggiata sta ad indicare i punti (x, y) di \mathbb{R}^2 per i quali si ha, rispettivamente: $(x, y) \geq (\bar{x}, \bar{y})$ nella figura di sinistra (ciò vale anche per i semiassi uscenti da (\bar{x}, \bar{y}) e per (\bar{x}, \bar{y}) stesso); $(x, y) > (\bar{x}, \bar{y})$ nella figura di centro (ciò vale anche per i semiassi uscenti da (\bar{x}, \bar{y}) , escluso però (\bar{x}, \bar{y}) stesso); $(x, y) \gg (\bar{x}, \bar{y})$ nella figura di destra (ciò non vale anche per i semiassi uscenti da (\bar{x}, \bar{y}) , che sono stati tratteggiati per sottolineare questo fatto, e per (\bar{x}, \bar{y})).

Visto che su \mathbb{R}^2 la relazione \geq è un ordine che non è totale, sarà difficile pretendere che $F(X)$ abbia massimo. E' più opportuno utilizzare l'idea di elemento massimale.

Se sono date $f, g : X \rightarrow \mathbb{R}$, ovvero $F : X \rightarrow \mathbb{R}^2$ ($F = (f, g)$), cercherò un elemento massimale per $F(X)$ e dirò che è un *ottimo paretiano* per F . Invece, dirò che un punto $\bar{x} \in X$ è un *punto di ottimo paretiano* se $F(\bar{x})$ è un ottimo paretiano per $F(X)$.

Per quanto abbiamo visto, non c'è ragione di attendersi che $F(X)$ abbia (se ce l'ha) un unico elemento massimale. E' sufficiente vedere la figura seguente per rendersi conto di quello che può accadere: in figura, la parte di bordo di $F(X)$ che è calcata individua i punti massimali per \geq su $F(X)$.



Un elemento \bar{t} che sia massimale per $F(X)$ viene detto “ottimo paretiano” (o “ottimo vettoriale”), mentre \bar{x} tale che $F(\bar{x}) = \bar{t}$ è detto “punto di ottimo paretiano”. La terminologia in uso nel contesto della ottimizzazione vettoriale è molto variegata (l’uso di un sinonimo anziché un altro dipende spesso da diverse tradizioni terminologiche in uso in discipline o spezzoni di discipline diversi) e quindi si possono trovare altri termini: \bar{t} viene detto valore efficiente, od ottimo vettoriale, o ottimo multicriterio; questa terminologia si riflette in modo ovvio su \bar{x} .

Sulla base di come è stata condotta finora la discussione dovrebbe essere evidente come l’idea di ottimo paretiano possa essere vista come una conseguenza della definizione di ottimo paretiano per un sottoinsieme B di \mathbb{R}^2 . Diremo evidentemente che $\bar{t} \in \mathbb{R}^2$ è ottimo paretiano se \bar{t} è un elemento massimale per \geq su B . Per la definizione di ottimo paretiano per una funzione non abbiamo fatto altro, quindi, che applicare questa definizione al caso in cui $B = F(X)$.

4 Ottimi paretiani deboli e forti

Se uno osserva la figura precedente può notare come i punti di ottimo paretiano siano caratterizzati dal fatto che in $F(X)$ non c’è alcun punto che sia “migliore” in senso stretto. Più precisamente, se \bar{t} è un ottimo paretiano non c’è alcun elemento $t \in F(X)$ per cui $t \geq \bar{t}$, eccezion fatta per \bar{t} . Possia-

mo esprimere in modo equivalente questo fatto dicendo che non c'è in $F(X)$ alcun elemento t tale che $t > \bar{t}$.

Questa considerazione, questa idea, non è certo specifica né di $F(X)$ né di \geq su \mathbb{R}^2 . Vediamo allora di fare un discorso generale.

Sia A un insieme sul quale sia definito un ordine \succeq . Cominciamo con l'osservare che, dato un ordine \succeq si può definire una nuova relazione \succ definita come:

$$a_1 \succ a_2 \quad \text{se e solo se} \quad [a_1 \succeq a_2 \text{ e } a_1 \neq a_2]$$

E' agevole dimostrare che la relazione \succ è un "ordine stretto", cioè è una relazione irreflessiva, antisimmetrica e transitiva.

Esercizio 4 Provare che \succ è effettivamente un ordine stretto.

Suggerimento

Che \succ sia irreflessiva e antisimmetrica è immediato. Solo un cenno a come si può dimostrare che \succ è transitiva. Occorre provare che $x \succ y$ e $y \succ z$ implicano che $x \succ z$. Che si ottenga $x \succeq z$ è ovvio. Supponiamo allora per assurdo che sia $x = z$. Ma allora le condizioni precedenti ($x \succ y$ e $y \succ z$) ci dicono che è $x \succ y$ e $y \succ x$ e questo viola la antisimmetria.

Premesso questo, sia A un insieme sul quale sia definito un ordine \succeq e sia $B \subseteq A$. Dire che un punto $\bar{b} \in B$ è massimale è equivalente a dire che non c'è alcun $b \in B$ tale che $b \succ \bar{b}$.

Esercizio 5 Provare che le due definizioni di elemento massimale sono effettivamente equivalenti.

Osservazione 4 *Attenzione: se \succeq è solo un preordine, nulla ci vieta naturalmente di definire la relazione \succ nello stesso modo usato nel caso degli ordini. Nulla ci garantisce però che la definizione di elemento massimale che avevamo dato sia ancora equivalente a questa nuova introdotta mediante \succ .*

Esercizio 6 Mostrare un esempio con un preordine per il quale l'equivalenza non è vera.

Se siamo in $B \subseteq \mathbb{R}^2$ (ma il discorso, oltre che ad \mathbb{R}^n può essere esteso oltre) e il nostro ordine è \geq , abbiamo quindi scoperto che un \bar{t} è massimale se e solo se non esiste $t \in B$ tale che $t > \bar{t}$. Abbiamo così nuovo modo di definire un ottimo paretiano.

Non solo! Possiamo anche seguire questa strada per introdurre idea di ottimo paretiano debole: diremo che $\bar{t} \in B$ è un ottimo paretiano debole se non esiste $t \in B$ t.c. $t \gg \bar{t}$.

Naturalmente, tutte queste considerazioni si applicano anche al caso che ci interessa, in cui $B = F(X)$.

5 Scalarizzazione

Per trovare ottimi paretiani o punti di ottimo paretiano, si può provare a ricondursi al caso di funzioni a valori reali. L'idea è quella di *scalarizzare* il problema (data $F = (f, g)$, possiamo interpretare quello che stiamo facendo come considerare una media pesata di f e g).

Questo metodo lo possiamo utilizzare sia per trovare un ottimo paretiano per un sottoinsieme B di \mathbb{R}^2 , che per cercare punti di ottimo paretiano ed ottimi paretiani per $F : X \rightarrow \mathbb{R}^2$.

Vediamo il caso in cui siamo interessati a trovare un ottimo paretiano per $B \subseteq \mathbb{R}^2$.

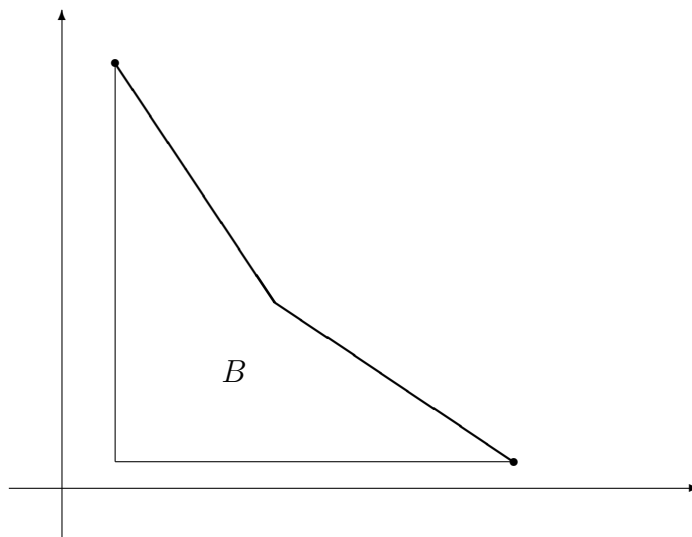
Prendiamo (λ, μ) , con $\lambda, \mu \geq 0$ e con $\lambda + \mu = 1$.

Cerchiamo un punto di massimo per $(u, v) \mapsto \lambda u + \mu v$ su B (si noti che la funzione che stiamo cercando di massimizzare è una funzione lineare).

Il punto di max del problema scalarizzato è un ottimo paretiano (stretto se i coefficienti sono entrambi positivi; debole se qualche coefficiente si può annullare (non tutti)). La dimostrazione è immediata.

Dato un problema di ottimizzazione vettoriale, si cerca il max di $\lambda f(x) + \mu g(x)$. Che ci dà un ottimo paretiano per F . Ovvero un punto di max per $\lambda f(x) + \mu g(x)$, che ci dà un punto di ottimo paretiano per F .

Non tutti gli ottimi paretiani si possono trovare per scalarizzazione. Nella figura seguente, tutti i punti del bordo che è calcato sono ottimi paretiani per B , ma solo i due punti evidenziati possono essere ottenuti mediante scalarizzazione.



Se però abbiamo che $B \subseteq \mathbb{R}^2$ è un insieme *convesso*, possiamo dimostrare che tutti i suoi punti di ottimo paretiano debole si possono ottenere per scalarizzazione.

Serve il:

Teorema 1 (Teorema di separazione di Minkowski) *Dati V, W sottoinsiemi di \mathbb{R}^n convessi, non vuoti e disgiunti, allora esiste un iperpiano che li separa. Cioè esistono $\lambda_1, \dots, \lambda_n$, non tutti nulli, tali che:*

$$\sum_{i=1}^n \lambda_i v_i \geq \sum_{i=1}^n \lambda_i w_i \quad \forall v \in V \quad \forall w \in W$$

Sia allora $B \subseteq \mathbb{R}^2$ (ci mettiamo in dimensione 2, ma il discorso è identico in dimensione n). Possiamo notare incidentalmente che in dimensione due il teorema di separazione ci dice che possiamo trovare una retta in modo che i due insiemi dati giacciono ognuno in uno dei due semipiani individuati dalla retta⁴.

⁴Nulla vieta che sulla retta ci possano anche essere punti dei due insiemi; addirittura può verificarsi il caso estremo che V e W siano entrambi sottoinsiemi della retta: se ad esempio $V = \{(1, 0)\}$ e W l'intervallo $[2, 3]$ sull'asse delle ascisse, proprio l'asse delle ascisse (cioè la retta di equazione $y = 0$) è una retta che separa V e W . Non è l'unica, naturalmente, in questo caso.

Dalla definizione di ottimo paretiano debole, si ottiene subito che $\bar{t} \in B$ è un ottimo paretiano debole se e solo se $B \cap (\bar{t} + \mathbb{R}_{>>}^2) = \emptyset$.

Supponiamo che B sia *convesso*. Possiamo allora usare il teorema di Minkowski (visto che l'altro insieme $\bar{t} + \mathbb{R}_{>>}^2$ è certamente convesso). Sia $\bar{t} = (\bar{u}, \bar{v})$ ottimo paretiano per B .

Allora, esiste un iperpiano che separa B e $\bar{t} + \mathbb{R}_{>>}^2$. Cioè esistono λ, μ , non entrambi nulli, tali che:

$$\lambda u_1 + \mu v_1 \geq \lambda u_2 + \mu v_2 \quad \forall (u_1, v_1) \in \bar{t} + \mathbb{R}_{>>}^2 \quad \forall (u_2, v_2) \in B$$

Cioè (prendendo: $(u_1, v_1) = (\bar{u}, \bar{v}) + (a, b)$ e chiamando $(u, v) = (u_2, v_2)$):

$$\lambda \bar{u} + \mu \bar{v} + \lambda a + \mu b \geq \lambda u + \mu v \quad \forall (a, b) \in \mathbb{R}_{>>}^2 \quad \forall (u, v) \in B$$

Osserviamo subito che $\lambda, \mu \geq 0$. Ciò si prova facilmente per assurdo. Se così non fosse, se fosse ad esempio $\lambda < 0$, basterebbe prendere a sufficientemente grande per violare la disequazione.

A questo punto, basta normalizzare (cioè dividere per $\lambda + \mu$) per soddisfare la condizione che la somma dei coefficienti faccia 1.

Non resta altro che un passaggio al limite per ottenere la tesi. Teniamo fisso $(u, v) \in B$ e facciamo tendere a e b a zero nell'ultima disequazione. Otteniamo:

$$\lambda \bar{u} + \mu \bar{v} \geq \lambda u + \mu v \quad \forall (a, b) \in \mathbb{R}_{>>}^2 \quad \forall (u, v) \in B$$

Ovvero, (\bar{u}, \bar{v}) rende massima la funzione $(u, v) \mapsto \lambda u + \mu v$ su B .

Per passare al caso in cui cerchiamo ottimi paretiani (o punti di ottimo paretiano) deboli per F , possiamo utilizzare i fatti seguenti:

- supponiamo $X \subseteq \mathbb{R}^k$, X convesso e non vuoto
- supponiamo che f e g siano concave

Lo scopo non è quello di ottenere che $F(X)$ è convesso, cosa che difficilmente si ottiene (anche nelle ipotesi dette). Si riesce però a dimostrare che $F(X) - \mathbb{R}_{\geq}^2$ è convesso.

Si dimostra inoltre facilmente che, in generale (cioè, per ogni sottoinsieme B di \mathbb{R}^2), $B \cap (\bar{t} + \mathbb{R}_{>>}^2) = \emptyset$ se e solo se $(B - \mathbb{R}_{\geq}^2) \cap (\bar{t} + \mathbb{R}_{>>}^2) = \emptyset$.

Si riesce così ad ottenere il teorema di scalarizzazione per F . Naturalmente, avremo a che fare con $(f(x), g(x))$ anziché con (u, v) e con $\bar{t} = (f(\bar{x}), g(\bar{x}))$ anziché con $\bar{t} = (\bar{u}, \bar{v})$, dove \bar{x} è un punto di ottimo paretiano debole per F .

Infatti è:

\bar{x} è un punto di ottimo paretiano debole per F su X
 se e solo se

$\bar{t} = (\bar{u}, \bar{v}) = F(\bar{x})$ è ottimo paretiano debole per $F(X)$
 se e solo se

$\bar{t} = (\bar{u}, \bar{v}) = F(\bar{x})$ è ottimo paretiano debole per $F(X) - \mathbb{R}_{\geq}^2$
 pertanto:

esistono $\lambda, \mu \geq 0$, non entrambi nulli, tali che $\lambda\bar{u} + \mu\bar{v} \geq \lambda u + \mu v \quad \forall (u, v) \in F(X) - \mathbb{R}_{\geq}^2$

Per questi λ, μ si ha quindi:

$\lambda f(\bar{x}) + \mu g(\bar{x}) \geq \lambda u + \mu v \quad \forall (u, v) \in F(X) - \mathbb{R}_{\geq}^2$
 e quindi, in particolare:

$\lambda f(\bar{x}) + \mu g(\bar{x}) \geq \lambda u + \mu v \quad \forall (u, v) \in F(X)$
 ovvero:

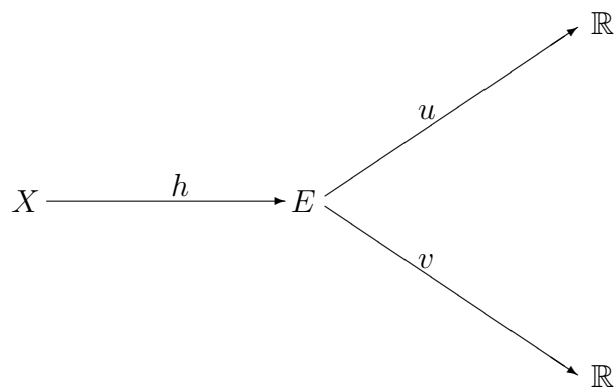
$\lambda f(\bar{x}) + \mu g(\bar{x}) \geq \lambda f(x) + \mu g(x) \quad \forall x \in X$

Pertanto, possiamo affermare che \bar{x} è punto di massimo per $x \mapsto \lambda f(x) + \mu g(x)$

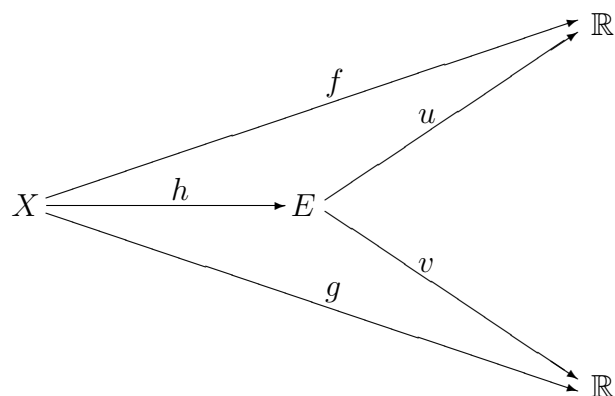
6 Ottimizzazione e teoria delle decisioni

Problemi di ottimizzazione vettoriale sorgono in teoria delle decisioni in una situazione come la seguente. Faccio riferimento alle decisioni in condizioni di certezza per concretezza, ma considerazioni analoghe valgono (con le modifiche opportune) per decisioni in condizioni di rischio e di incertezza. Abbiamo un insieme X di alternative, ed una funzione h che mappa gli elementi di X in un insieme di esiti E . Se gli esiti riguardano due decisori (o, in generale, più di un decisore) avremo due funzioni di utilità u e v definite su E ed a valori in \mathbb{R} .

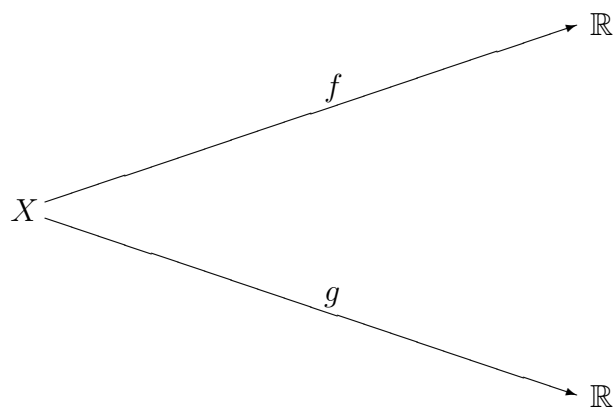
La seguente figura descrive la situazione.



Possiamo naturalmente considerare le funzioni composte $f = u \circ h$ e $g = v \circ h$, come evidenziato nella figura sottostante:



Eliminando i dettagli inessenziali, come nella figura seguente, troviamo esattamente il quadro che abbiamo visto nella impostazione dei problemi di ottimizzazione vettoriale. La funzione $F: X \rightarrow \mathbb{R}$ è quindi individuata dalla coppia di funzioni $f, g: X \rightarrow \mathbb{R}$.



L'idea della ottimizzazione vettoriale è quindi quella di scegliere una alternativa $\bar{x} \in X$ per la quale non ve ne sia un'altra giudicata migliore da entrambi i decisori.

Vi è un'altra sorgente “fondamentale” di un problema di ottimizzazione vettoriale: è quando un decisore⁵ ha difficoltà a sintetizzare in un unico criterio di valutazione più criteri parziali. Ad esempio, nella scelta di un'auto uno può avere delle preferenze chiare per quanto riguarda sia le prestazioni sia il prezzo, ma gli potrebbe essere difficile esprimere delle preferenze complessive.

7 Appendice: preordini e loro aggregazione

Come era stato detto all'inizio (vedi pagina 2), vi sono due diversi punti di vista, che offrono due diversi percorsi di generalizzazione.

Mi limiterò a due brevi note. In realtà si potrebbe fare un discorso molto articolato e con propaggini fin verso la teoria delle scelte sociali.

Anche tenendo presente i riferimenti che sono stati fatti ai problemi di decisione, possiamo osservare come in un problema di ricerca del *punto* di massimo per una funzione, ciò che davvero importa è solo il preordine totale \succeq_f che essa induce su X . Ricordo che, data $f : X \rightarrow \mathbb{R}$, possiamo definire la relazione \succeq_f su X nel modo seguente:

$$x_1 \succeq_f x_2 \quad \text{se e solo se} \quad f(x_1) \geq f(x_2)$$

Quindi, la ricerca di un *punto di massimo* per f è equivalente alla ricerca del *massimo* per \succeq_f .

⁵Caso particolarmente rilevante è quando il decisore è in realtà un organo rappresentativo di una pluralità di cittadini o, in genere, di più individui. Si pensi ad una amministrazione provinciale che deve scegliere la localizzazione di un inceneritore (pardon, termovalorizzatore).

Si noti il completo ribaltamento di prospettiva che si opera, seguendo questa strada anziché quella che abbiamo usato in precedenza. Non solo, questo nuovo punto di vista può essere portato avanti fino ad assumere una visione radicalmente diversa. Possiamo cioè ritenere che il dato del problema non sia una funzione f , ma un preordine totale \succeq . Se così è, possiamo allora parlare ovviamente del problema di massimo per \succeq su X , senza fare riferimento ad alcuna funzione a valori reali.

Insomma, si può assumere che su un dato insieme X siano ad esempio definiti due preordini \succeq_I e \succeq_{II} , che rappresentano le preferenze di due individui. Ci si può porre il problema di trovare un elemento $\bar{x} \in X$ per cui, se si riesce a trovare un elemento $x \in X$ tale che sia $x \succeq_I \bar{x}$ e $x \succeq_{II} \bar{x}$, allora sia necessariamente $x = \bar{x}$. O varianti sul tema.