

Um método inexato de decomposição para minimizar a soma
de duas funções convexas

MAJELA PENTÓN MACHADO *

Abstract

Faremos uma breve introdução ao problema geral de minimizar uma função no \mathbb{R}^n . Discutiremos condições necessárias e suficientes de otimalidade e o famoso método do gradiente. Além disso, apresentamos o problema de minimizar a soma de duas funções convexas (não necessariamente diferenciáveis) e uma versão inexata do método de gradiente proximal para resolver este problema. Analisamos as propriedades de convergência deste método, assim como algumas aplicações.

References

- [1] Yu. Nesterov. Introductory Lectures on Convex Optimization. Kluwer, Boston (2004).
- [2] Millán, R.D. and Machado, M.P. Inexact proximal ϵ -subgradient methods for composite convex optimization problems. J Glob Optim (2019). <https://doi.org/10.1007/s10898-019-00808-8>

Tipo de Apresentação: Palestra

*e-mail: majentcha@gmail.com