Ottimizzazione Non Lineare

G. Liuzzi[1]

Mercoledì 13 Dicembre 2017

[1] Istituto di Analisi dei Sistemi ed Informatica IASI - CNR

Definizione del problema

$$\begin{array}{l} \min\ f(x) \\ s.t.\ x \in \mathbb{R}^n \end{array}$$

dove:

- $f : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$;
- $S \subset \mathbb{R}^n$, convesso

Definizione del problema

$$\begin{array}{l} \min \; f(x) \\ s.t. \; x \in S \end{array}$$

dove:

- $f : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$;
- $S \subset \mathbb{R}^n$, convesso

Difinizioni

Definizione (Direzione di discesa)

Sia $x \in S$ *e* $f : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$. *Si dice che* $d \in \mathbb{R}^n$, $d \neq 0$, *è una direzione di discesa per* f *in* x *se esiste un* $\bar{t} > 0$ *tale che*

$$f(x + td) < f(x), \quad \textit{per ogni } t \in (0, \bar{t}]$$

Definizione (Direzione ammissibile)

Sia $x \in S$. *Si dice che* $d \in \mathbb{R}^n$, $d \neq 0$, *è una direzione ammissibile per* S *in* x *se esiste un* $\bar{t} > 0$ *tale che*

$$x + td \in S, \quad \textit{per ogni } t \in [0, \bar{t}]$$

Difinizioni

Definizione (Direzione di discesa)

Sia $x \in S$ *e* $f : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}$*. Si dice che* $d \in \mathbb{R}^n$, $d \neq 0$, *è una direzione di discesa per* f *in* x *se esiste un* $\bar{t} > 0$ *tale che*

$$f(x + td) < f(x), \quad \text{per ogni } t \in (0, \bar{t}]$$

Definizione (Direzione ammissibile)

Sia $x \in S$*. Si dice che* $d \in \mathbb{R}^n$, $d \neq 0$, *è una direzione ammissibile per* S *in* x *se esiste un* $\bar{t} > 0$ *tale che*

$$x + td \in S, \quad \text{per ogni } t \in [0, \bar{t}]$$

C.N. di ottimo locale

Consideriamo un punto ammissibile $\bar{x} \in S$ e supponiamo che in $\bar{x}$ esista una direzione $d \in \mathbb{R}^n, d \neq 0$ che sia contemporaneamente **ammissibile** e **di discesa**.

Allora, in ogni intorno di $\bar{x}$ è possibile trovare, per $t > 0$ suff. piccolo, un punto $\bar{x} + td$ tale che

$$\bar{x} + td \in S$$

$$f(\bar{x} + td) < f(\bar{x})$$

Quindi $\bar{x}$ **non può essere** minimo locale del problema

C.N. di ottimo locale

Consideriamo un punto ammissibile $\bar{x} \in S$ e supponiamo che in $\bar{x}$ esista una direzione $d \in \mathbb{R}^n$, $d \neq 0$ che sia contemporaneamente **ammissibile** e **di discesa**.

Allora, in ogni intorno di $\bar{x}$ è possibile trovare, per $t > 0$ suff. piccolo, un punto $\bar{x} + td$ tale che

$$\bar{x} + td \in S$$
$$f(\bar{x} + td) < f(\bar{x})$$

Quindi $\bar{x}$ **non può essere** minimo locale del problema

C.N. di ottimo locale

Consideriamo un punto ammissibile $\bar{x} \in S$ e supponiamo che in $\bar{x}$ esista una direzione $d \in \mathbb{R}^n, d \neq 0$ che sia contemporaneamente **ammissibile** e **di discesa**.

Allora, in ogni intorno di $\bar{x}$ è possibile trovare, per $t > 0$ suff. piccolo, un punto $\bar{x} + td$ tale che

$$\bar{x} + td \in S$$
$$f(\bar{x} + td) < f(\bar{x})$$

Quindi $\bar{x}$ **non può essere** minimo locale del problema

C.N. di ottimo locale

Consideriamo un punto ammissibile $\bar{x} \in S$ e supponiamo che in $\bar{x}$ esista una direzione $d \in \mathbb{R}^n, d \neq 0$ che sia contemporaneamente **ammissibile** e **di discesa**.
Allora, in ogni intorno di $\bar{x}$ è possibile trovare, per $t > 0$ suff. piccolo, un punto $\bar{x} + td$ tale che

$$\bar{x} + td \in S$$
$$f(\bar{x} + td) < f(\bar{x})$$

Quindi $\bar{x}$ **non può essere** minimo locale del problema

C.N. di ottimo locale

Consideriamo un punto ammissibile $\bar{x} \in S$ e supponiamo che in $\bar{x}$ esista una direzione $d \in \mathbb{R}^n, d \neq 0$ che sia contemporaneamente **ammissibile** e **di discesa**.

Allora, in ogni intorno di $\bar{x}$ è possibile trovare, per $t > 0$ suff. piccolo, un punto $\bar{x} + td$ tale che

$$\begin{aligned} &\bar{x} + td \in S \\ &f(\bar{x} + td) < f(\bar{x}) \end{aligned}$$

Quindi $\bar{x}$ **non può essere** minimo locale del problema

C.N. di ottimo locale (1)

Rimane quindi provato

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema, allora non può esistere in x^* una direzione ammissibile (per S) che sia anche di discesa (per f).

Se f è differenziabile, la condizione

$$\nabla f(x)^\top d < 0$$

è sufficiente affinché d sia di discesa per f in x. Quindi

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema e f cont. differenziabile in un intorno di x^*.
Allora non può esistere in x^* una direzione ammissibile tale che $\nabla f(x^*)^\top d < 0$, o equivalentemente,

$$\nabla f(x^*)^\top d \geq 0, \quad \text{per ogni } d \text{ ammissibile in } x^*$$

C.N. di ottimo locale (1)

Rimane quindi provato

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema, allora non può esistere in x^* una direzione ammissibile (per S) che sia anche di discesa (per f).

Se f è differenziabile, la condizione

$$\nabla f(x)^\top d < 0$$

è sufficiente affinché d sia di discesa per f in x. Quindi

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema e f cont. differenziabile in un intorno di x^*.
Allora non può esistere in x^* una direzione ammissibile tale che $\nabla f(x^*)^\top d < 0$, o equivalentemente,

$$\nabla f(x^*)^\top d \geq 0, \quad \text{per ogni } d \text{ ammissibile in } x^*$$

C.N. di ottimo locale (1)

Rimane quindi provato

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema, allora non può esistere in x^* una direzione ammissibile (per S) che sia anche di discesa (per f).

Se f è differenziabile, la condizione

$$\nabla f(x)^\top d < 0$$

è sufficiente affinché d sia di discesa per f in x. Quindi

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema e f cont. differenziabile in un intorno di x^*.
Allora non può esistere in x^* una direzione ammissibile tale che $\nabla f(x^*)^\top d < 0$, o equivalentemente,

$$\nabla f(x^*)^\top d \geq 0, \quad \text{per ogni } d \text{ ammissibile in } x^*$$

Caratterizzazione delle dir. ammissibili

Supponiamo di conoscere un punto $\bar{x} \in S$ e che $S \neq \{\bar{x}\}$.

Comunque scelto un punto $x \in S$, $x \neq \bar{x}$, per la convessità di S abbiamo che

$$(1-t)\bar{x} + tx \in S, \quad \text{per ogni } t \in [0,1]$$

e quindi,

$$\bar{x} + t(x - \bar{x}) \in S, \quad \text{per ogni } t \in [0,1],$$

ovvero $d = x - \bar{x} \neq 0$ è ammissibile per S in $\bar{x}$.
Inversamente, se $d \neq 0$ è ammissibile per S in $\bar{x}$, esiste un $t > 0$ tale che

$$\bar{x} + td = x \in S$$

ovvero $d = (x - \bar{x})/t = \lambda(x - \bar{x})$

Caratterizzazione delle dir. ammissibili

Supponiamo di conoscere un punto $\bar{x} \in S$ e che $S \neq \{\bar{x}\}$.

Comunque scelto un punto $x \in S$, $x \neq \bar{x}$, per la convessità di S abbiamo che

$$(1-t)\bar{x} + tx \in S, \quad \text{per ogni } t \in [0,1]$$

e quindi,

$$\bar{x} + t(x - \bar{x}) \in S, \quad \text{per ogni } t \in [0,1],$$

ovvero $d = x - \bar{x} \neq 0$ è ammissibile per S in $\bar{x}$.
Inversamente, se $d \neq 0$ è ammissibile per S in $\bar{x}$, esiste un $t > 0$ tale che

$$\bar{x} + td = x \in S$$

ovvero $d = (x - \bar{x})/t = \lambda(x - \bar{x})$

Caratterizzazione delle dir. ammissibili

Supponiamo di conoscere un punto $\bar{x} \in S$ e che $S \neq \{\bar{x}\}$.

Comunque scelto un punto $x \in S$, $x \neq \bar{x}$, per la convessità di S abbiamo che

$$(1-t)\bar{x} + tx \in S, \quad \text{per ogni } t \in [0,1]$$

e quindi,

$$\bar{x} + t(x - \bar{x}) \in S, \quad \text{per ogni } t \in [0,1],$$

ovvero $d = x - \bar{x} \neq 0$ è ammissibile per S in $\bar{x}$.

Inversamente, se $d \neq 0$ è ammissibile per S in $\bar{x}$, esiste un $t > 0$ tale che

$$\bar{x} + td = x \in S$$

ovvero $d = (x - \bar{x})/t = \lambda(x - \bar{x})$

Caratterizzazione delle dir. ammissibili

Supponiamo di conoscere un punto $\bar{x} \in S$ e che $S \neq \{\bar{x}\}$.

Comunque scelto un punto $x \in S$, $x \neq \bar{x}$, per la convessità di S abbiamo che

$$(1-t)\bar{x} + tx \in S, \quad \text{per ogni } t \in [0,1]$$

e quindi,

$$\bar{x} + t(x - \bar{x}) \in S, \quad \text{per ogni } t \in [0,1],$$

ovvero $d = x - \bar{x} \neq 0$ è ammissibile per S in $\bar{x}$.
Inversamente, se $d \neq 0$ è ammissibile per S in $\bar{x}$, esiste un $t > 0$ tale che

$$\bar{x} + td = x \in S$$

ovvero $d = (x - \bar{x})/t = \lambda(x - \bar{x})$

Caratterizzazione delle dir. ammissibili

Proposizione

Sia $\bar{x} \in S$ e $S \neq \{\bar{x}\}$. Allora, per ogni $x \in S$, $x \neq \bar{x}$, la direzione $d = x - \bar{x}$ è ammissibile per S in $\bar{x}$, e viceversa

C.N. di ottimo locale (2)

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema e f cont. differenziabile in un intorno di x^*.
Allora,

$$\nabla f(x^*)^\top (x - x^*) \geq 0, \quad \textit{per ogni } x \in S$$

Dim. Se $S = \{x^*\}$, la condizione è banalmente soddisfatta.
Supponiamo quindi che $S \neq \{x^*\}$ cioè che esista $x \in S$, $x \neq x^*$.
Qualunque sia x, sappiamo che $d = x - x^*$ è ammissibile per S in x^* e che $\nabla f(x^*)^\top d \geq 0$. $\square$

C.N. di ottimo locale (2)

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema e f cont. differenziabile in un intorno di x^*.
Allora,

$$\nabla f(x^*)^\top (x - x^*) \geq 0, \quad \textit{per ogni } x \in S$$

Dim. Se $S = \{x^*\}$, la condizione è banalmente soddisfatta.
Supponiamo quindi che $S \neq \{x^*\}$ cioè che esista $x \in S$, $x \neq x^*$.
Qualunque sia x, sappiamo che $d = x - x^*$ è ammissibile per S in x^* e che $\nabla f(x^*)^\top d \geq 0$. $\square$

C.N. di ottimo locale (2)

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema e f cont. differenziabile in un intorno di x^*.
Allora,

$$\nabla f(x^*)^\top (x - x^*) \geq 0, \quad \text{per ogni } x \in S$$

Dim. Se $S = \{x^*\}$, la condizione è banalmente soddisfatta.
Supponiamo quindi che $S \neq \{x^*\}$ cioè che esista $x \in S$, $x \neq x^*$.
Qualunque sia x, sappiamo che $d = x - x^*$ è ammissibile per S in x^* e che $\nabla f(x^*)^\top d \geq 0$. $\square$

C.N. di ottimo locale (2)

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema e f cont. differenziabile in un intorno di x^*.
Allora,

$$\nabla f(x^*)^\top (x - x^*) \geq 0, \quad \textit{per ogni } x \in S$$

Dim. Se $S = \{x^*\}$, la condizione è banalmente soddisfatta.
Supponiamo quindi che $S \neq \{x^*\}$ cioè che esista $x \in S$, $x \neq x^*$.
Qualunque sia x, sappiamo che $d = x - x^*$ è ammissibile per S in x^* e che $\nabla f(x^*)^\top d \geq 0$. $\square$

C.N. di ottimo locale (2)

Proposizione

Sia x^* un punto di minimo locale del problema e f cont. differenziabile in un intorno di x^*.
Allora,

$$\nabla f(x^*)^\top (x - x^*) \geq 0, \quad \textit{per ogni } x \in S$$

Dim. Se $S = \{x^*\}$, la condizione è banalmente soddisfatta.
Supponiamo quindi che $S \neq \{x^*\}$ cioè che esista $x \in S$, $x \neq x^*$.
Qualunque sia x, sappiamo che $d = x - x^*$ è ammissibile per S in x^* e che $\nabla f(x^*)^\top d \geq 0$. $\square$

Ricerca lungo una direzione ammissibile

Supponiamo che:

1. $\bar{x} \in S$
2. $\bar{x} + \bar{d} \in S$, quindi $\bar{d}$ è ammissibile per S in $\bar{d}$
3. $\nabla f(\bar{x})^\top \bar{d} < 0$, quindi $\bar{d}$ è di discesa per f in $\bar{x}$

ricerca unidimensionale di Armijo con passo iniziale $\alpha = 1$

Dati: $\gamma \in (0,1)$, $\delta \in (0,1)$

Poni $\alpha \leftarrow 1$

while $f(\bar{x} + \alpha \bar{d}) > f(\bar{x}) + \gamma \alpha \nabla f(\bar{x})^\top \bar{d}$

Poni $\alpha \leftarrow \delta \alpha$

end while

Poni $\bar{\alpha} \leftarrow \alpha$

Ricerca lungo una direzione ammissibile

Supponiamo che:

1. $\bar{x} \in S$
2. $\bar{x} + \bar{d} \in S$, quindi $\bar{d}$ è ammissibile per S in $\bar{d}$
3. $\nabla f(\bar{x})^\top \bar{d} < 0$, quindi $\bar{d}$ è di discesa per f in $\bar{x}$

ricerca unidimensionale di Armijo con passo iniziale $\alpha = 1$

Dati: $\gamma \in (0,1)$, $\delta \in (0,1)$

Poni $\alpha \leftarrow 1$

while $f(\bar{x} + \alpha\bar{d}) > f(\bar{x}) + \gamma\alpha\nabla f(\bar{x})^\top \bar{d}$

Poni $\alpha \leftarrow \delta\alpha$

end while

Poni $\bar{\alpha} \leftarrow \alpha$

La ricerca unidimensionale di Armijo è ben posta

Si nota facilmente che (sotto le condizioni poste) la ricerca di Armijo si arresta sempre in un numero finito di passi determinando un $\bar{\alpha} \in (0, 1]$ tale che

- $\bar{x} + \bar{\alpha}\bar{d} \in S$
- $f(\bar{x} + \bar{\alpha}\bar{d}) \leq f(\bar{x}) + \gamma\bar{\alpha}\nabla f(\bar{x})^\top \bar{d} < f(\bar{x})$

Il metodo di Armijo

Sia $\{d_k\}$ una successione infinita di direzioni tale che:

1. $x_k + d_k \in S$, quindi d_k è ammissibile per S in x_k
2. $\nabla f(x_k)^\top d_k < 0$, quindi d_k è di discesa per f in x_k

Dati: $x_0 \in S$, $\gamma \in (0,1)$, $\delta \in (0,1)$

for $k = 0, 1, \ldots$

$x_{k+1} \leftarrow x_k + \alpha_k d_k$

con α_k calcolato dalla ricerca unidimensionale di Armijo

end for

Convergenza del metodo di Armijo

Proposizione

Sia f continuamente differenziabile su un aperto contenente S. Supponiamo S compatto (oltre che convesso). Il metodo di Armijo produce una successione infinita di punti $\{x_k\}$. Se la successione $\{d_k\}$ è tale che, per ogni k,

ii) $x_k + d_k \in S$

iii) $\nabla f(x_k)^\top d_k < 0$

allora,

1. $x_{k+1} \in S$
2. $f(x_{k+1}) < f(x_k)$
3. $\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = 0$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Dim. La dimostrazione di (1) e (2) è banale. Quindi rimane da far vedere che vale la (3).

Osserviamo che, essendo $x_k \in S$ e $x_k + d_k \in S$, la compattezza di S implica che $\{\|d_k\|\}$ è limitata, ossia esiste $M > 0$ tale che $\|d_k\| \le M$.
Infatti, $\|d_k\| = \|d_k + x_k - x_k\| \le \|x_k + d_k\| + \|x_k\| \le M$
Dalle proprietà di α_k, possiamo scrivere

$$f(x_k) - f(x_{k+1}) \ge \gamma\alpha_k|\nabla f(x_k)^\top d_k|$$

e quindi

$$\lim_{k\to\infty} \alpha_k|\nabla f(x_k)^\top d_k| = 0.$$

Procediamo per assurdo e supponiamo che la (3) non sia vera. Allora deve esistere una sottosucc. e un numero $\eta > 0$ tale che

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = -\eta < 0 \quad \text{e quindi} \quad \lim_{k\to\infty} \alpha_k = 0.$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Dim. La dimostrazione di (1) e (2) è banale. Quindi rimane da far vedere che vale la (3).
Osserviamo che, essendo $x_k \in S$ e $x_k + d_k \in S$, la compattezza di S implica che $\{\|d_k\|\}$ è limitata, ossia esiste $M > 0$ tale che $\|d_k\| \leq M$.
Infatti, $\|d_k\| = \|d_k + x_k - x_k\| \leq \|x_k + d_k\| + \|x_k\| \leq M$
Dalle proprietà di α_k, possiamo scrivere

$$f(x_k) - f(x_{k+1}) \geq \gamma\alpha_k|\nabla f(x_k)^\top d_k|$$

e quindi

$$\lim_{k\to\infty} \alpha_k|\nabla f(x_k)^\top d_k| = 0.$$

Procediamo per assurdo e supponiamo che la (3) non sia vera. Allora deve esistere una sottosucc. e un numero $\eta > 0$ tale che

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = -\eta < 0 \quad \text{e quindi} \quad \lim_{k\to\infty} \alpha_k = 0.$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Dim. La dimostrazione di (1) e (2) è banale. Quindi rimane da far vedere che vale la (3).
Osserviamo che, essendo $x_k \in S$ e $x_k + d_k \in S$, la compattezza di S implica che $\{\|d_k\|\}$ è limitata, ossia esiste $M > 0$ tale che $\|d_k\| \leq M$.
Infatti, $\|d_k\| = \|d_k + x_k - x_k\| \leq \|x_k + d_k\| + \|x_k\| \leq M$
Dalle proprietà di α_k, possiamo scrivere

$$f(x_k) - f(x_{k+1}) \geq \gamma\alpha_k|\nabla f(x_k)^\top d_k|$$

e quindi

$$\lim_{k\to\infty} \alpha_k|\nabla f(x_k)^\top d_k| = 0.$$

Procediamo per assurdo e supponiamo che la (3) non sia vera. Allora deve esistere una sottosucc. e un numero $\eta > 0$ tale che

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = -\eta < 0 \quad \text{e quindi} \quad \lim_{k\to\infty} \alpha_k = 0.$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Dim. La dimostrazione di (1) e (2) è banale. Quindi rimane da far vedere che vale la (3).
Osserviamo che, essendo $x_k \in S$ e $x_k + d_k \in S$, la compattezza di S implica che $\{\|d_k\|\}$ è limitata, ossia esiste $M > 0$ tale che $\|d_k\| \leq M$.
Infatti, $\|d_k\| = \|d_k + x_k - x_k\| \leq \|x_k + d_k\| + \|x_k\| \leq M$
Dalle proprietà di α_k, possiamo scrivere

$$f(x_k) - f(x_{k+1}) \geq \gamma\alpha_k|\nabla f(x_k)^\top d_k|$$

e quindi

$$\lim_{k\to\infty} \alpha_k|\nabla f(x_k)^\top d_k| = 0.$$

Procediamo per assurdo e supponiamo che la (3) non sia vera. Allora deve esistere una sottosucc. e un numero $\eta > 0$ tale che

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = -\eta < 0 \quad \text{e quindi} \quad \lim_{k\to\infty} \alpha_k = 0.$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Dim. La dimostrazione di (1) e (2) è banale. Quindi rimane da far vedere che vale la (3).
Osserviamo che, essendo $x_k \in S$ e $x_k + d_k \in S$, la compattezza di S implica che $\{\|d_k\|\}$ è limitata, ossia esiste $M > 0$ tale che $\|d_k\| \leq M$.
Infatti, $\|d_k\| = \|d_k + x_k - x_k\| \leq \|x_k + d_k\| + \|x_k\| \leq M$
Dalle proprietà di α_k, possiamo scrivere

$$f(x_k) - f(x_{k+1}) \geq \gamma \alpha_k |\nabla f(x_k)^\top d_k|$$

e quindi

$$\lim_{k\to\infty} \alpha_k |\nabla f(x_k)^\top d_k| = 0.$$

Procediamo per assurdo e supponiamo che la (3) non sia vera. Allora deve esistere una sottosucc. e un numero $\eta > 0$ tale che

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = -\eta < 0 \quad \text{e quindi} \quad \lim_{k\to\infty} \alpha_k = 0.$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Inoltre, devono esistere sottosuccessioni tali che

$$\lim_{k\to\infty} x_k = \hat{x} \in S \quad \text{e} \quad \lim_{k\to\infty} d_k = \hat{d}$$

da cui segue

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = \nabla f(\hat{x})^\top \hat{d} = -\eta. < 0$$

Siccome $\alpha_k \to 0$, per k suff. grande deve risultare $\alpha_k < 1$ e quindi

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) > f(x_k) + \gamma \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(x_k)^\top d_k$$

per il Teorema della Media abbiamo

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) = f(x_k) + \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(z_k)^\top d_k, \quad z_k = x_k + \theta_k \frac{\alpha_k}{\delta} d_k,\ \theta_k \in (0,1)$$

per cui otteniamo

$$\nabla f(z_k)^\top d_k > \gamma \nabla f(x_k)^\top d_k$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Inoltre, devono esistere sottosuccessioni tali che

$$\lim_{k\to\infty} x_k = \hat{x} \in S \quad \text{e} \quad \lim_{k\to\infty} d_k = \hat{d}$$

da cui segue

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = \nabla f(\hat{x})^\top \hat{d} = -\eta. < 0$$

Siccome $\alpha_k \to 0$, per k suff. grande deve risultare $\alpha_k < 1$ e quindi

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) > f(x_k) + \gamma \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(x_k)^\top d_k$$

per il Teorema della Media abbiamo

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) = f(x_k) + \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(z_k)^\top d_k, \quad z_k = x_k + \theta_k \frac{\alpha_k}{\delta} d_k,\ \theta_k \in (0,1)$$

per cui otteniamo

$$\nabla f(z_k)^\top d_k > \gamma \nabla f(x_k)^\top d_k$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Inoltre, devono esistere sottosuccessioni tali che

$$\lim_{k\to\infty} x_k = \hat{x} \in S \quad \text{e} \quad \lim_{k\to\infty} d_k = \hat{d}$$

da cui segue

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = \nabla f(\hat{x})^\top \hat{d} = -\eta. < 0$$

Siccome $\alpha_k \to 0$, per k suff. grande deve risultare $\alpha_k < 1$ e quindi

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) > f(x_k) + \gamma \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(x_k)^\top d_k$$

per il Teorema della Media abbiamo

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) = f(x_k) + \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(z_k)^\top d_k, \quad z_k = x_k + \theta_k \frac{\alpha_k}{\delta} d_k,\ \theta_k \in (0,1)$$

per cui otteniamo

$$\nabla f(z_k)^\top d_k > \gamma \nabla f(x_k)^\top d_k$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Inoltre, devono esistere sottosuccessioni tali che

$$\lim_{k\to\infty} x_k = \hat{x} \in S \quad \text{e} \quad \lim_{k\to\infty} d_k = \hat{d}$$

da cui segue

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = \nabla f(\hat{x})^\top \hat{d} = -\eta. < 0$$

Siccome $\alpha_k \to 0$, per k suff. grande deve risultare $\alpha_k < 1$ e quindi

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) > f(x_k) + \gamma \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(x_k)^\top d_k$$

per il Teorema della Media abbiamo

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) = f(x_k) + \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(z_k)^\top d_k, \quad z_k = x_k + \theta_k \frac{\alpha_k}{\delta} d_k, \; \theta_k \in (0,1)$$

per cui otteniamo

$$\nabla f(z_k)^\top d_k > \gamma \nabla f(x_k)^\top d_k$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Inoltre, devono esistere sottosuccessioni tali che

$$\lim_{k\to\infty} x_k = \hat{x} \in S \quad \text{e} \quad \lim_{k\to\infty} d_k = \hat{d}$$

da cui segue

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = \nabla f(\hat{x})^\top \hat{d} = -\eta. < 0$$

Siccome $\alpha_k \to 0$, per k suff. grande deve risultare $\alpha_k < 1$ e quindi

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) > f(x_k) + \gamma \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(x_k)^\top d_k$$

per il Teorema della Media abbiamo

$$f\left(x_k + \frac{\alpha_k}{\delta} d_k\right) = f(x_k) + \frac{\alpha_k}{\delta} \nabla f(z_k)^\top d_k, \quad z_k = x_k + \theta_k \frac{\alpha_k}{\delta} d_k, \ \theta_k \in (0,1)$$

per cui otteniamo

$$\nabla f(z_k)^\top d_k > \gamma \nabla f(x_k)^\top d_k$$

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Prendendo il limite per $k \to \infty$, e ricordando che $\lim_{k\to\infty} \alpha_k \|d_k\| = 0$ per cui $\lim_{k\to\infty} z_k = \hat{x}$, otteniamo

$$\nabla f(\hat{x})^\top \hat{d} \geq \gamma \nabla f(\hat{x})^\top \hat{d}$$

ovvero $\eta \leq \gamma\eta$, da cui seguirebbe $\gamma \geq 1$. $\square$

Per stabilire la convergenza dell'algoritmo a punti critici del problema (cioè punti che soddisfano C.N. di ottimo), è sufficiente mostrare che d_k sia scelta in modo tale che

1. sia una direzione ammissibile
2. sia una direzione di discesa
3. $\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = 0$ implichi la convergenza a punti critici.

Convergenza del metodo di Armijo (segue)

Prendendo il limite per $k \to \infty$, e ricordando che $\lim_{k\to\infty} \alpha_k \|d_k\| = 0$ per cui $\lim_{k\to\infty} z_k = \hat{x}$, otteniamo

$$\nabla f(\hat{x})^\top \hat{d} \geq \gamma \nabla f(\hat{x})^\top \hat{d}$$

ovvero $\eta \leq \gamma\eta$, da cui seguirebbe $\gamma \geq 1$. $\square$

Per stabilire la convergenza dell'algoritmo a punti critici del problema (cioè punti che soddisfano C.N. di ottimo), è sufficiente mostrare che d_k sia scelta in modo tale che

1. sia una direzione ammissibile
2. sia una direzione di discesa
3. $\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = 0$ implichi la convergenza a punti critici.

Introduzione

Ricordiamo che S è un insieme convesso e compatto.

Dato $x_k \in S$, un metodo per cercare una direzione che sia contemporaneamente di discesa ed ammissibile è quello di risolvere il problema

$$\begin{array}{l} \min \ \nabla f(x_k)^\top (x - x_k) \\ s.t. \ x \in S \end{array}$$

Il problema ammette sempre soluzione ottima $\hat{x}_k \in S$ e risulta $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) \leq 0$.

Se $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) = 0$ allora

$$0 = \nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) \leq \nabla f(x_k)^\top (x - x_k), \quad \text{per ogni } x \in S$$

cioè x_k è un punto critico.

Se invece $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) < 0$, la direzione $d_k = \hat{x}_k - x_k$ è una direzione ammissibile e di discesa in x_k e definire l'iterazione

$$x_{k+1} = x_k + \alpha_k d_k$$

Introduzione

Ricordiamo che S è un insieme convesso e compatto.

Dato $x_k \in S$, un metodo per cercare una direzione che sia contemporaneamente di discesa ed ammissibile è quello di risolvere il problema

$$\begin{array}{l} \min \ \nabla f(x_k)^\top (x - x_k) \\ s.t. \ x \in S \end{array}$$

Il problema ammette sempre soluzione ottima $\hat{x}_k \in S$ e risulta $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) \leq 0$.

Se $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) = 0$ allora

$$0 = \nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) \leq \nabla f(x_k)^\top (x - x_k), \quad \text{per ogni } x \in S$$

cioè x_k è un punto critico.

Se invece $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) < 0$, la direzione $d_k = \hat{x}_k - x_k$ è una direzione ammissibile e di discesa in x_k e definire l'iterazione

$$x_{k+1} = x_k + \alpha_k d_k$$

Introduzione

Ricordiamo che S è un insieme convesso e compatto.

Dato $x_k \in S$, un metodo per cercare una direzione che sia contemporaneamente di discesa ed ammissibile è quello di risolvere il problema

$$\begin{array}{l} \min \ \nabla f(x_k)^\top (x - x_k) \\ s.t. \ x \in S \end{array}$$

Il problema ammette sempre soluzione ottima $\hat{x}_k \in S$ e risulta $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) \le 0$.

Se $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) = 0$ allora

$$0 = \nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) \le \nabla f(x_k)^\top (x - x_k), \quad \text{per ogni } x \in S$$

cioè x_k è un punto critico.

Se invece $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) < 0$, la direzione $d_k = \hat{x}_k - x_k$ è una direzione ammissibile e di discesa in x_k e definire l'iterazione

$$x_{k+1} = x_k + \alpha_k d_k$$

Introduzione

Ricordiamo che S è un insieme convesso e compatto.

Dato $x_k \in S$, un metodo per cercare una direzione che sia contemporaneamente di discesa ed ammissibile è quello di risolvere il problema

$$\begin{array}{l} \min\ \nabla f(x_k)^\top (x - x_k) \\ s.t.\ x \in S \end{array}$$

Il problema ammette sempre soluzione ottima $\hat{x}_k \in S$ e risulta $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) \leq 0$.

Se $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) = 0$ allora

$$0 = \nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) \leq \nabla f(x_k)^\top (x - x_k), \quad \text{per ogni } x \in S$$

cioè x_k è un punto critico.

Se invece $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) < 0$, la direzione $d_k = \hat{x}_k - x_k$ è una direzione ammissibile e di discesa in x_k e definire l'iterazione

$$x_{k+1} = x_k + \alpha_k d_k$$

Metodo di Frank-Wolfe

INPUT: $x_0 \in S$, $\gamma \in (0,1)$, $\delta \in (0,1)$

for $k = 0, 1, \ldots$

Calcola una soluzione $\hat{x}_k$ di $\min_{x \in S} \nabla f(x_k)^\top (x - x_k)$

if $\nabla f(x_k)^\top (\hat{x}_k - x_k) = 0$ **then** STOP

Poni $d_k = \hat{x}_k - x_k$ e calcola α_k con una ricerca di linea di Armijo

Poni $x_{k+1} = x_k + \alpha_k d_k$

end for

Convergenza

Proposizione

Sia f cont.differenziabile su un aperto contenente S e $\{x_k\}$ la succ. prodotta dal metodo di F-W. Allora,

- *o esiste una iterazione ν tale che x_ν è un punto critico;*
- *oppure $\{x_k\}$ è infinita ed ogni punto di accumulazione è critico.*

Dim. Supponiamo che l'algoritmo non si arresti mai. Allora, risultano verificate le ipotesi del metodo di Armijo, percui

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = 0.$$

Per la compattezza di S deve esistere un punto di accumulazione $\bar{x}$, inoltre d_k è limitata.
Possiamo quindi definire una sottosucc. K tale che

$$\lim_{k\to\infty, k\in K} x_k = \bar{x}, \qquad \lim_{k\to\infty, k\in K} d_k = \bar{d}$$

Convergenza

Proposizione

Sia f cont.differenziabile su un aperto contenente S e $\{x_k\}$ la succ. prodotta dal metodo di F-W. Allora,

- *o esiste una iterazione ν tale che x_ν è un punto critico;*
- *oppure $\{x_k\}$ è infinita ed ogni punto di accumulazione è critico.*

Dim. Supponiamo che l'algoritmo non si arresti mai. Allora, risultano verificate le ipotesi del metodo di Armijo, percui

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = 0.$$

Per la compattezza di S deve esistere un punto di accumulazione $\bar{x}$, inoltre d_k è limitata.

Possiamo quindi definire una sottosucc. K tale che

$$\lim_{k\to\infty, k\in K} x_k = \bar{x}, \qquad \lim_{k\to\infty, k\in K} d_k = \bar{d}$$

Convergenza

Proposizione

Sia f cont.differenziabile su un aperto contenente S e $\{x_k\}$ la succ. prodotta dal metodo di F-W. Allora,

- *o esiste una iterazione ν tale che x_ν è un punto critico;*
- *oppure $\{x_k\}$ è infinita ed ogni punto di accumulazione è critico.*

Dim. Supponiamo che l'algoritmo non si arresti mai. Allora, risultano verificate le ipotesi del metodo di Armijo, percui

$$\lim_{k\to\infty} \nabla f(x_k)^\top d_k = 0.$$

Per la compattezza di S deve esistere un punto di accumulazione $\bar{x}$, inoltre d_k è limitata.
Possiamo quindi definire una sottosucc. K tale che

$$\lim_{k\to\infty, k\in K} x_k = \bar{x}, \quad \lim_{k\to\infty, k\in K} d_k = \bar{d}$$

Convergenza (segue)

da cui segue

$$\nabla f(\bar{x})^\top \bar{d} = 0.$$

In base alla definizione di d_k segue che

$$\nabla f(x_k)^\top d_k \leq \nabla f(x_k)^\top (x - x_k), \quad \text{per ogni } x \in S.$$

Quindi, prendendo il limite $k \to \infty, k \in K$

$$0 = \nabla f(\bar{x})^\top \bar{d} \leq \nabla f(\bar{x})^\top (x - \bar{x}), \quad \text{per ogni } x \in S$$

che prova che $\bar{x}$ è un punto critico.

Convergenza (segue)

da cui segue

$$\nabla f(\bar{x})^\top \bar{d} = 0.$$

In base alla definizione di d_k segue che

$$\nabla f(x_k)^\top d_k \leq \nabla f(x_k)^\top (x - x_k), \quad \text{per ogni } x \in S.$$

Quindi, prendendo il limite $k \to \infty, k \in K$

$$0 = \nabla f(\bar{x})^\top \bar{d} \leq \nabla f(\bar{x})^\top (x - \bar{x}), \quad \text{per ogni } x \in S$$

che prova che $\bar{x}$ è un punto critico.

Convergenza (segue)

da cui segue

$$\nabla f(\bar{x})^\top \bar{d} = 0.$$

In base alla definizione di d_k segue che

$$\nabla f(x_k)^\top d_k \leq \nabla f(x_k)^\top (x - x_k), \quad \text{per ogni } x \in S.$$

Quindi, prendendo il limite $k \to \infty, k \in K$

$$0 = \nabla f(\bar{x})^\top \bar{d} \leq \nabla f(\bar{x})^\top (x - \bar{x}), \quad \text{per ogni } x \in S$$

che prova che $\bar{x}$ è un punto critico.