Пусть имеется матрица обучающих признаков и

вектор-столбец целевого действия, где

Пусть ;

Тогда определим задачу оптимизации как

1. Записать субградиент или его компоненты на выпуклом компакте…
2. Нужно выбрать прокси-функцию, например:
   1. , исходная норма - Евклидова
   2. по опр. прокси-функции (0 \*ln(0) = 0) по непрерывности, исходная норма
   3. ,

Рассмотреть свойства

Как проверить предполагаемую выпуклость?