

# Отчёт по лабораторной работе

## Метод градиентного спуска

### 1 Постановка задачи

В работе реализуется метод градиентного спуска для минимизации следующих функций:

$$\begin{aligned}J_1(x, y) &= x^2 + y^2, \\J_2(x, y) &= \frac{x^2}{a^2} + \frac{y^2}{b^2}, \\J_3(x, y) &= 70(x - 1)^2 + (y - 1)^2 + 1, \\J_4(x, y) &= (x - 8)^2 + (y - 1)^2 + 70(y + (x - 8)^2 - 1)^2 + 1,\end{aligned}$$

где параметры  $a, b$  задают большую и малую полуоси эллипса во второй функции.

Метод градиентного спуска настраивается по:

- начальной точке  $x_0 = (x_0, y_0)$ ;
- режиму выбора шага  $h_k$ ;
- значению шага  $h$  (или параметрам  $c, \alpha$  для убывающих шагов);
- критерию остановки: по числу итераций, по норме разности векторов  $\|x_{k+1} - x_k\|$ , по изменению функционала  $|J(x_{k+1}) - J(x_k)|$ .

### 2 Описание метода

На  $k$ -й итерации метода градиентного спуска вычисляется шаг

$$x_{k+1} = x_k - h_k \nabla J(x_k),$$

где  $h_k$  выбирается в одном из следующих режимов:

- постоянный шаг:  $h_k = h$ ;
- убывающий шаг вида

$$h_k = c(1 + k)^{-\alpha}, \quad c > 0, \quad 0.5 < \alpha \leq 1;$$

- шаг вида

$$h_k = \frac{c}{k + 1}, \quad c > 0,$$

удовлетворяющий условиям

$$h_k > 0, \quad \sum_{k=0}^{\infty} h_k = \infty, \quad \sum_{k=0}^{\infty} h_k^2 < \infty.$$

Критерии остановки:

- ограничение сверху на число итераций  $k_{\max}$ ;
- достижение малой нормы приращения аргумента:

$$\|x_{k+1} - x_k\| < \varepsilon_x;$$

- достижение малой разности значений функционала:

$$|J(x_{k+1}) - J(x_k)| < \varepsilon_f.$$

В реализованном коде используются значения

$$\varepsilon_x = 10^{-6}, \quad \varepsilon_f = 10^{-6},$$

а максимальное число итераций выбирается равным  $k_{\max} = 20000$ .

### 3 Численные эксперименты

Для каждой функции рассматриваются два режима шага:

- постоянный шаг ( $h_k = h$ );
- убывающий шаг вида  $h_k = c(1 + k)^{-\alpha}$ .

Отдельно демонстрируется режим  $h_k = c/(k + 1)$  на функции  $J_1$ .

Начальные точки и значения шагов:

В численных экспериментах для функции  $J_2$  использовались значения  $a = 5$ ,  $b = 1$ , что соответствует вытянутому эллипсу уровней вдоль оси  $x$ .

- $J_1$ :  $x_0 = (5, 5)$ , постоянный шаг  $h = 0.2$ , убывающий шаг  $h_k = 0.5(1 + k)^{-0.6}$ ;
- $J_2$ :  $x_0 = (5, 3)$ , постоянный шаг  $h = 0.2$ , убывающий шаг  $h_k = 0.5(1 + k)^{-0.6}$ ;
- $J_3$ :  $x_0 = (-5, 5)$ , постоянный шаг  $h = 0.01$ , убывающий шаг  $h_k = 0.5(1 + k)^{-0.9}$ ;
- $J_4$ :  $x_0 = (8, 3)$ , постоянный шаг  $h = 0.001$ , убывающий шаг  $h_k = 0.05(1 + k)^{-0.9}$ ;
- демонстрация шага  $h_k = \frac{0.5}{k + 1}$  для  $J_1$ .

### 3.1 Функция $J_1(x, y) = x^2 + y^2$

#### Траектории на плоскости

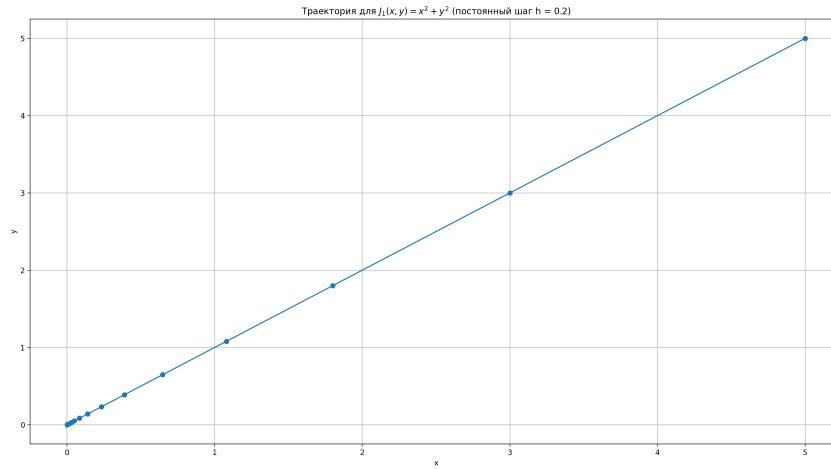


Рис. 1: Траектория градиентного спуска для  $J_1$  при постоянном шаге (файл `f1_traj_constant.png`).

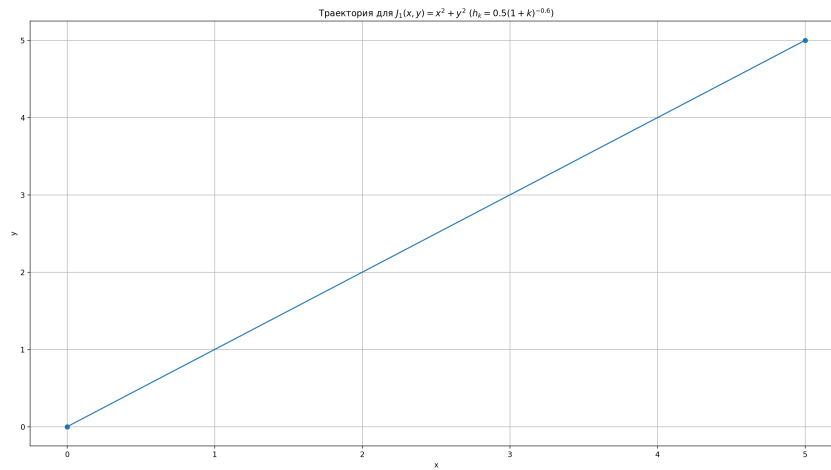


Рис. 2: Траектория градиентного спуска для  $J_1$  при убывающем шаге  $h_k = 0.5(1 + k)^{-0.6}$  (файл `f1_traj_power.png`).

Если используется демонстрация режима  $h_k = 0.5/(k + 1)$ , то соответствующий график траектории:

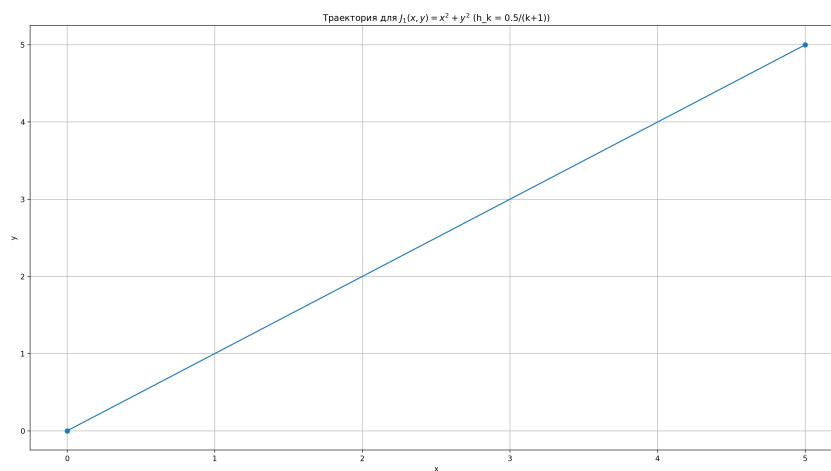


Рис. 3: Траектория градиентного спуска для  $J_1$  при шаге  $h_k = 0.5/(k + 1)$  (файл f1\_traj\_1\_over\_k.png).

### Убывание значения функционала $J_1(x_k)$

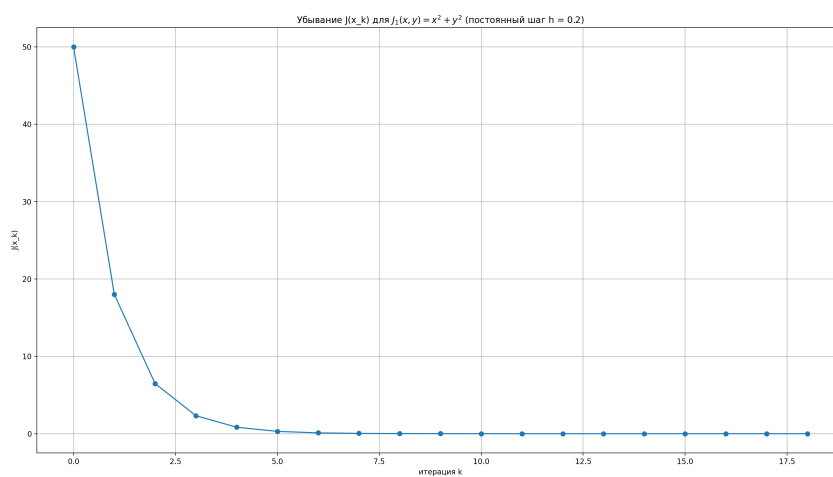


Рис. 4: График убывания  $J_1(x_k)$  при постоянном шаге (файл f1\_J\_constant.png).

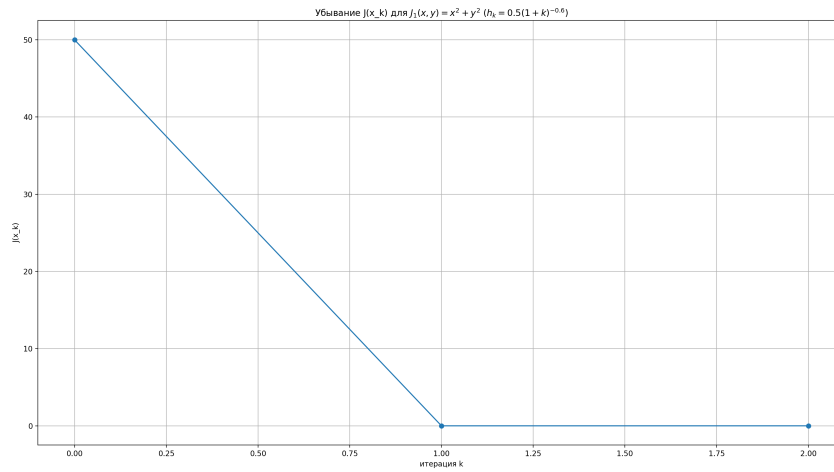


Рис. 5: График убывания  $J_1(x_k)$  при убывающем шаге  $h_k = 0.5(1+k)^{-0.6}$  (файл f1\_J\_power.png).

При необходимости:

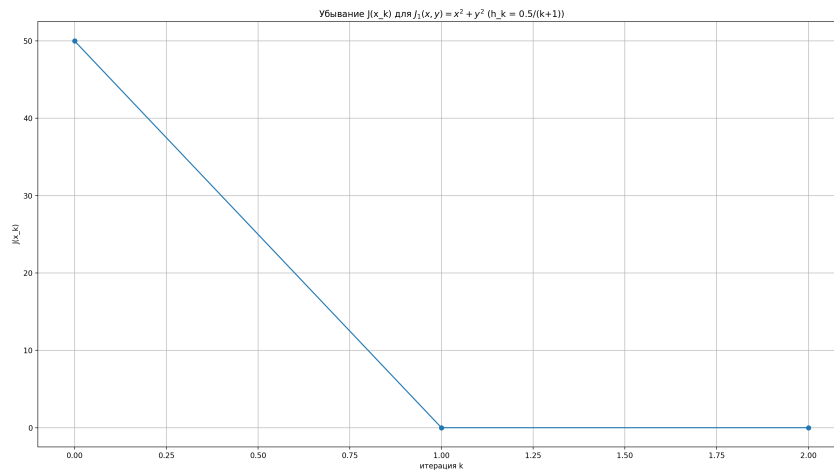


Рис. 6: График убывания  $J_1(x_k)$  при шаге  $h_k = 0.5/(k+1)$  (файл f1\_J\_1\_over\_k.png).

## 3.2 Функция $J_2(x, y) = \frac{x^2}{a^2} + \frac{y^2}{b^2}$

### Траектории на плоскости

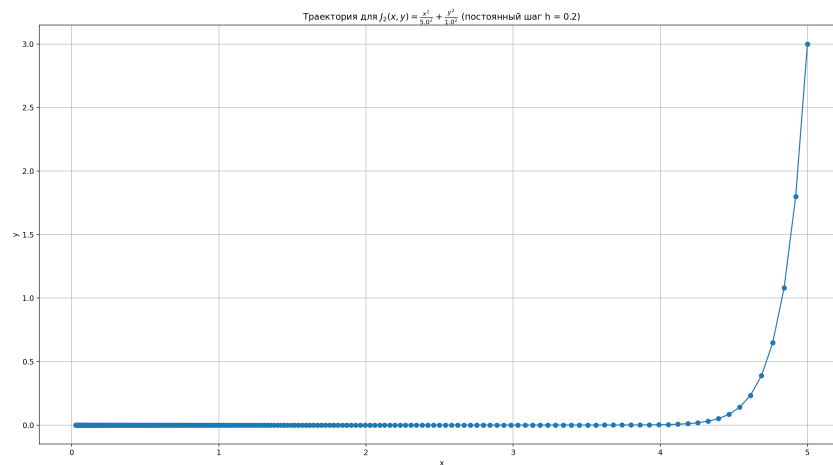


Рис. 7: Траектория градиентного спуска для  $J_2$  при постоянном шаге (файл f2\_traj\_constant.png).

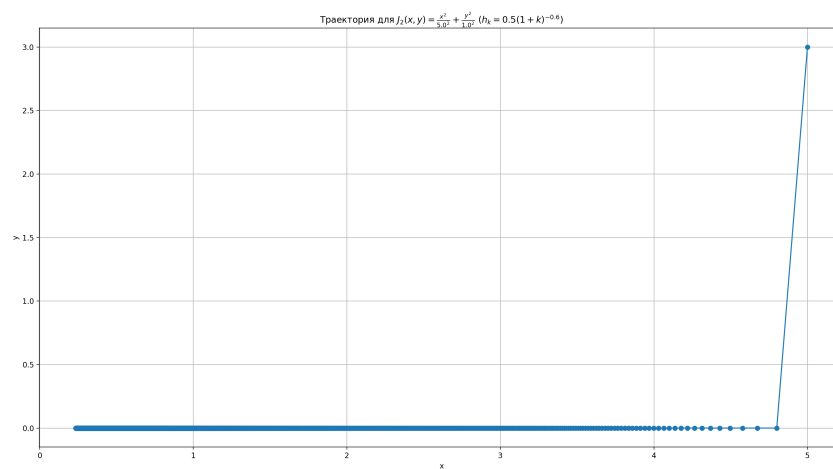


Рис. 8: Траектория градиентного спуска для  $J_2$  при убывающем шаге  $h_k = 0.5(1+k)^{-0.6}$  (файл f2\_traj\_power.png).

## Убывание $J_2(x_k)$

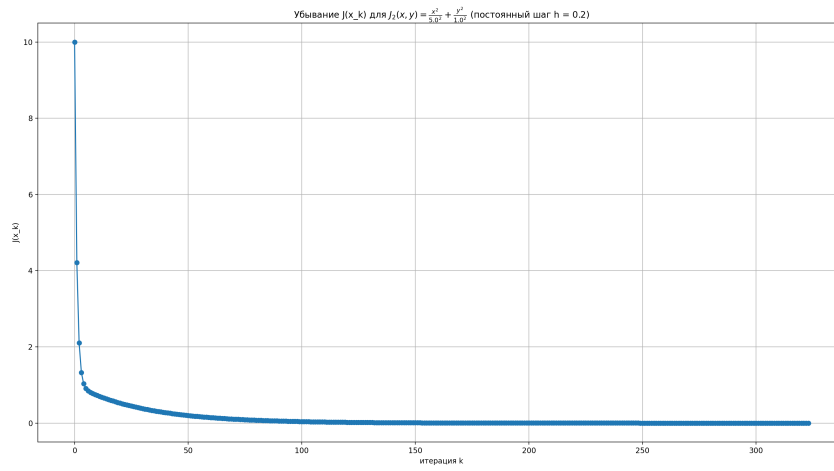


Рис. 9: График убывания  $J_2(x_k)$  при постоянном шаге (файл f2\_J\_constant.png).

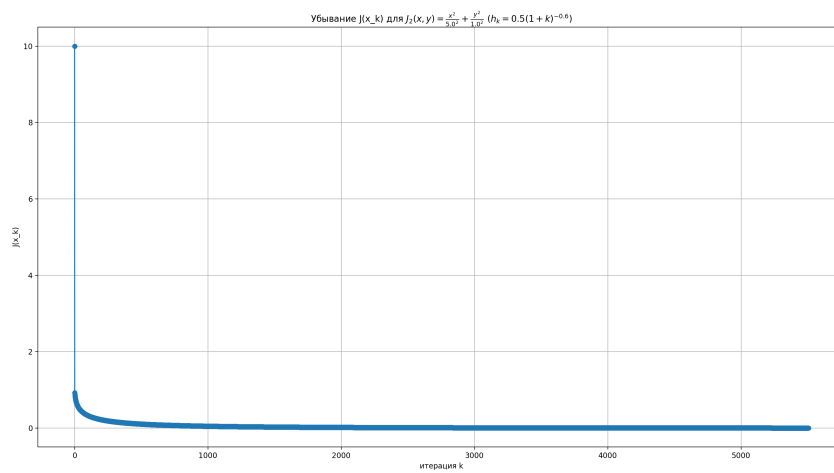


Рис. 10: График убывания  $J_2(x_k)$  при убывающем шаге (файл f2\_J\_power.png).

### 3.3 Функция $J_3(x, y) = 70(x - 1)^2 + (y - 1)^2 + 1$

#### Траектории на плоскости

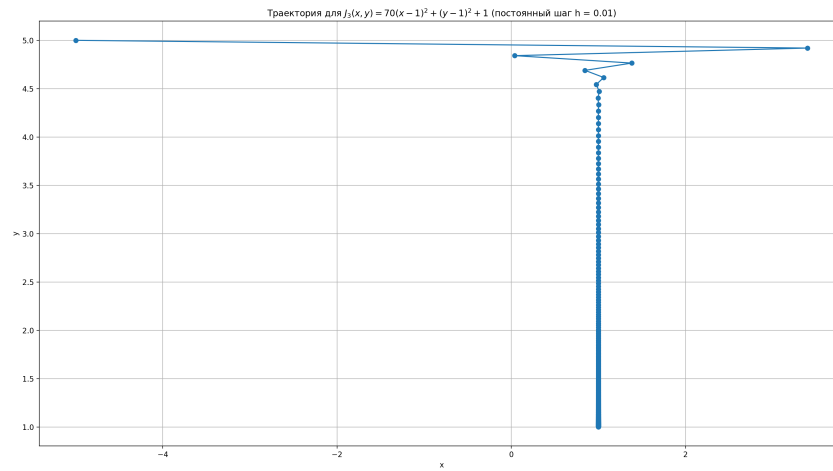


Рис. 11: Траектория градиентного спуска для  $J_3$  при постоянном шаге (файл f3\_traj\_constant.png).

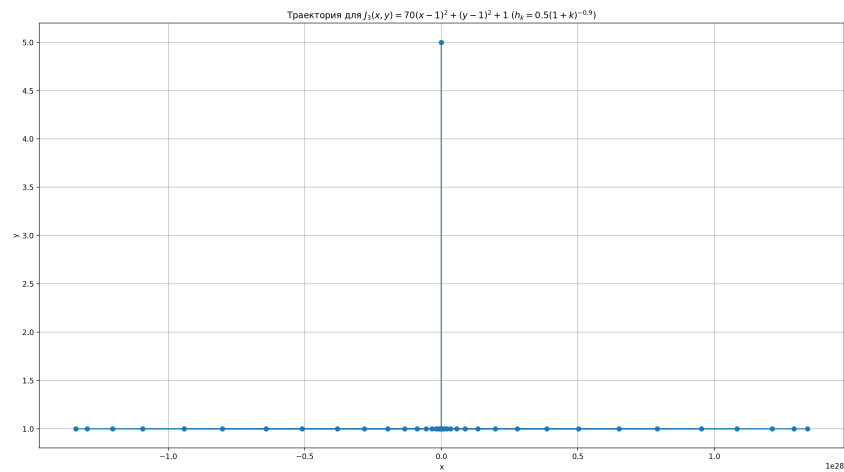


Рис. 12: Траектория градиентного спуска для  $J_3$  при убывающем шаге  $h_k = 0.5(1 + k)^{-0.9}$  (файл f3\_traj\_power.png).

## Убывание $J_3(x_k)$

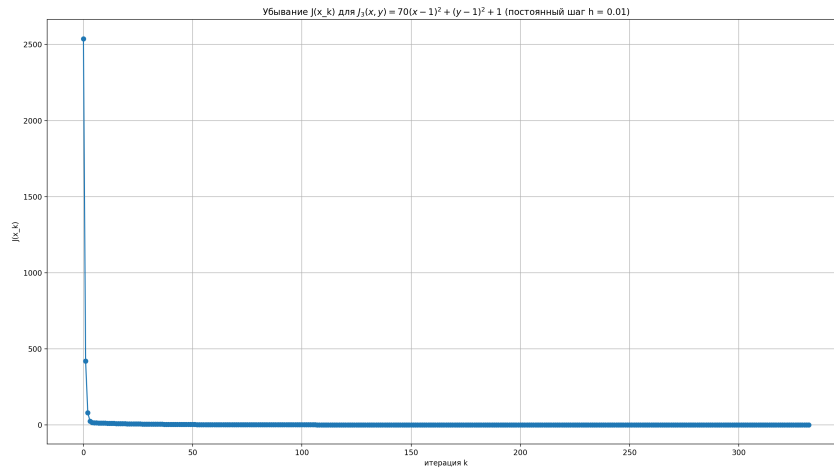


Рис. 13: График убывания  $J_3(x_k)$  при постоянном шаге (файл f3\_J\_constant.png).

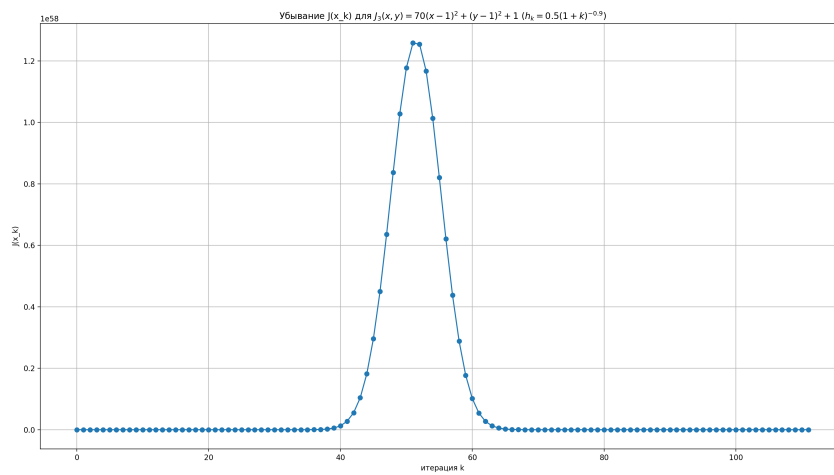


Рис. 14: График убывания  $J_3(x_k)$  при убывающем шаге (файл f3\_J\_power.png).

### 3.4 Функция $J_4(x, y)$

#### Траектории на плоскости

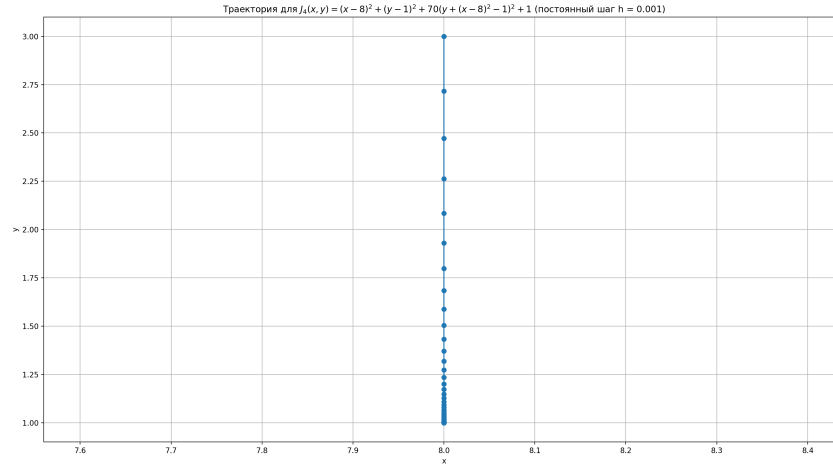


Рис. 15: Траектория градиентного спуска для  $J_4$  при постоянном шаге (файл `f4_traj_constant.png`).

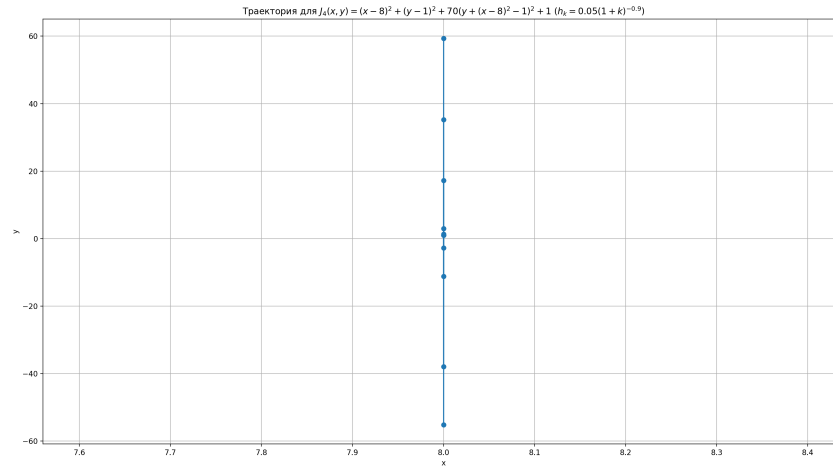


Рис. 16: Траектория градиентного спуска для  $J_4$  при убывающем шаге  $h_k = 0.05(1 + k)^{-0.9}$  (файл `f4_traj_power.png`).

## Убывание $J_4(x_k)$

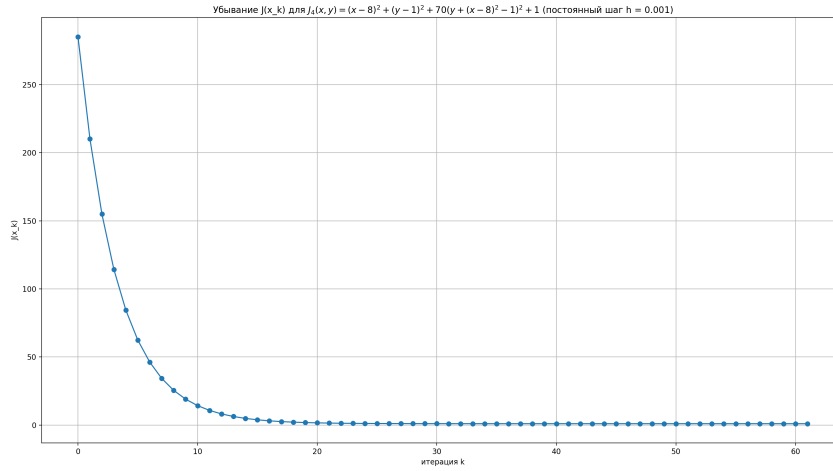


Рис. 17: График убывания  $J_4(x_k)$  при постоянном шаге (файл f4\_J\_constant.png).

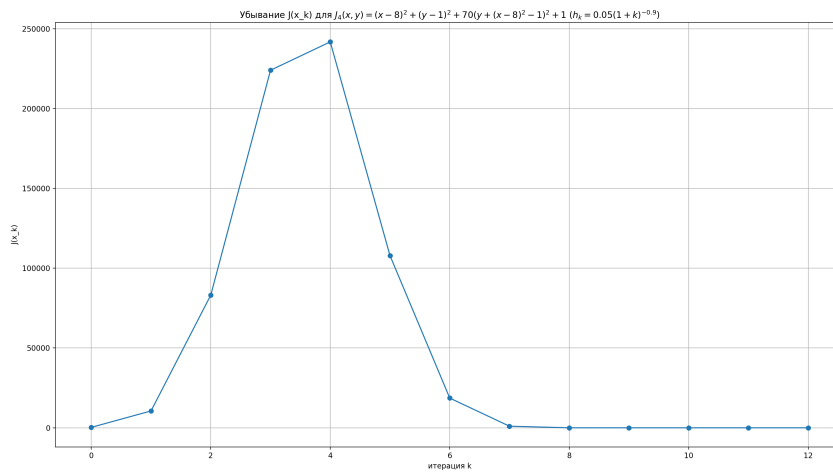


Рис. 18: График убывания  $J_4(x_k)$  при убывающем шаге (файл f4\_J\_power.png).

## 4 Итоговые точки минимума

Результаты работы метода сведены в таблицу

Функция	Режим шага	Найденная точка $x^*$	$J(x^*)$	Критерий останковки
$J_1$	постоянный шаг $h = 0.2$	(0.000508, 0.000508)	0.00000052	tol_f: $ J_{(k+1)} - J_k  = 9.17e-07$
$J_1$	$h_k = 0.5(1 + k)^{-0.6}$	(0.000000, 0.000000)	0.00000000	tol_x: $ x_{(k+1)} - x_k  = 0.00e+00$
$J_2$	постоянный шаг $h = 0.2$	(0.027314, 0.000000)	0.00002984	tol_f: $ J_{(k+1)} - J_k  = 9.78e-07$
$J_2$	$h_k = 0.5(1 + k)^{-0.6}$	(0.234139, 0.000000)	0.00219284	tol_f: $ J_{(k+1)} - J_k  = 1.00e-06$
$J_3$	постоянный шаг $h = 0.01$	(1.000000, 1.004888)	1.00002389	tol_f: $ J_{(k+1)} - J_k  = 9.85e-07$
$J_3$	$h_k = 0.5(1 + k)^{-0.9}$	(1.000000, 1.000000)	1.00000000	tol_f: $ J_{(k+1)} - J_k  = 1.90e-08$
$J_4$	постоянный шаг $h = 0.001$	(8.000000, 1.000175)	1.00000218	tol_f: $ J_{(k+1)} - J_k  = 7.82e-07$
$J_4$	$h_k = 0.05(1 + k)^{-0.9}$	(8.000000, 1.000028)	1.00000005	tol_f: $ J_{(k+1)} - J_k  = 8.79e-07$
$J_1$	$h_k = 0.5/(k + 1)$	(0.000000, 0.000000)	0.00000000	tol_x: $ x_{(k+1)} - x_k  = 0.00e+00$

Таблица 1: Итоговые точки минимума и значения функционала для разных режимов шага.

## 5 Выводы

По результатам численных экспериментов можно сделать следующие выводы.

1. Для всех рассмотренных функций  $J_1$ – $J_4$  метод градиентного спуска сходится к аналитически известным точкам минимума:  $J_1$  и  $J_2$  — к точке  $(0, 0)$ ,  $J_3$  — к точке  $(1, 1)$ ,  $J_4$  — к точке  $(8, 1)$ . Численные значения  $x^*$  и  $J(x^*)$ , приведённые в таблице ??, совпадают с теоретическими с погрешностью порядка  $10^{-3}$ – $10^{-6}$ .
2. На хорошо обусловленной квадратичной функции  $J_1$  постоянный шаг и убывающий шаг демонстрируют быструю и стабильную сходимость. При разумном выборе  $h$  постоянный шаг обеспечивает почти геометрическое убывание  $J(x_k)$ . Шаг вида  $h_k = c(1 + k)^{-\alpha}$  даёт более плавную, но гарантированно устойчивую сходимость.
3. Для вытянутой квадратичной функции  $J_2$  влияние обусловленности заметно сильнее: траектория с постоянным шагом существенно искривлена, и сходится медленнее вдоль “длинной” оси эллипса. Переход к убывающему шагу частично сглаживает колебания и делает поведение метода более устойчивым, хотя скорость сходимости на начальных итерациях снижается.
4. Для функции  $J_3$  с сильно различающимися коэффициентами по  $x$  и  $y$  (жёсткое направление по  $x$ ) требуются малые значения постоянного шага, иначе возникает риск расходимости. Убывающий шаг позволяет выбрать более агрессивное начальное значение и при этом гарантировать сходимость за счёт постепенного уменьшения  $h_k$ .
5. Для нелинейной функции  $J_4$  с узкой искривлённой долиной градиентный спуск чувствителен к выбору шага: слишком большие значения  $h$  приводят к “прыжкам” поперёк долины и замедлению сходимости. Правильно подобранный постоянный шаг и убывающий шаг обеспечивают движение вдоль долины к минимуму, что видно на траекториях и графиках убывания  $J(x_k)$ .
6. Шаг вида  $h_k = \frac{c}{k+1}$  на примере функции  $J_1$  демонстрирует теоретически корректное поведение: условия  $\sum h_k = \infty$  и  $\sum h_k^2 < \infty$  выполняются, метод сходится к минимуму, однако убывание значения функционала происходит медленнее, чем при оптимально подобранном постоянном шаге.