Regiões de confiança - métodos específicos

No esquema geral, devemos calcular d^k solução aproximada do modelo

$$\min_d \ m(d) = f(x^k) + \nabla f(x^k)^t d + \frac{1}{2} d^t B_k d$$
$$\text{s.a. } \|d\| \leq \Delta_k .$$

Para garantir convergência, d^k deve satisfazer a hipótese H3 (veja anotações sobre convergência).

O objetivo é discutir diferentes formas de fazer isso.

1ª forma: passo de Cauchy

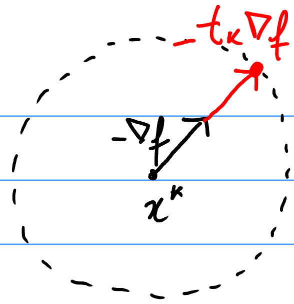
Supomos que $d^k = -t_k \nabla f(x^k)$, onde $t_k > 0$ é solução de

$$\min_t \ m(-t\nabla f(x^k)) \qquad \text{s.a. } \|t\nabla f(x^k)\| \leq \Delta_k$$

($\|\cdot\|$ = norma Euclideana)

Resolvendo (omitindo x^k):

- Se $\nabla f^t B_k \nabla f \leq 0$ então o termo quadrático $d^t B_k d = t^2 \nabla f^t B_k \nabla f \leq 0$ não influencia na minimiza ção, e a solução estará na borda:



$$\|t_k\nabla f\| = \Delta_k \Rightarrow t_k = \frac{\Delta_k}{\|\nabla f\|}.$$

- Se $\nabla f^t B_k \nabla f > 0$ então a solução pode não estar na borda. Temos que olhar para o minimizador irrestrito de $m(d)$:

$$\frac{d}{dt} m(-t\nabla f) = -\|\nabla f\|^2 + t(\nabla f^t B_k \nabla f) = 0$$

$$\Rightarrow t^* = \frac{\|\nabla f\|^2}{\nabla f^t B_k \nabla f} > 0.$$

Caso $t^* < \frac{\Delta_k}{\|\nabla f\|}$ então $t_k = t^*$. Caso contrário, $t_k = \frac{\Delta_k}{\|\nabla f\|}$. Em resumo,

$$(*) \quad d^k = -t_k \nabla f(x^k) \quad \text{onde} \quad t_k = \begin{cases} \dfrac{\Delta_k}{\|\nabla f\|} & \text{se } \nabla f^t B_k \nabla f \leq 0 \\ \min\left\{\dfrac{\Delta_k}{\|\nabla f\|}, \dfrac{\|\nabla f\|^2}{\nabla f^t B \nabla f}\right\} & \text{c.c.} \end{cases}$$

Com o passo de Cauchy, há convergência:

Teorema: O passo de Cauchy satisfaz

$$m(0) - m(d^k) \geq \frac{1}{2}\|\nabla f(x^k)\| \cdot \min\left\{\Delta_k, \frac{\|\nabla f(x^k)\|}{\|B_k\|}\right\}$$ (H3 com $c = \frac{1}{2}$)

Prova: Como $d^k = -t_k \nabla f$, temos

$$m(0) - m(d^k) = f(x^k) - f(x^k) - \nabla f^t d^k - \frac{1}{2} {d^k}^t B_k d^k$$
$$= t_k \|\nabla f\|^2 - \frac{1}{2} t_k^2 \nabla f^t B_k \nabla f.$$

CASO 1: $\nabla f^t B_k \nabla f \leq 0$

De $(*)$, $t_k = \dfrac{\Delta_k}{\|\nabla f\|}$ e $m(0) - m(d^k) \geq t_k \|\nabla f\|^2 = \Delta_k \|\nabla f\|$.

Em particular, $m(0) - m(d^k) \geq \frac{1}{2} \|\nabla f\| \Delta_k$. (1)

CASO 2: $\nabla f^t B_k \nabla f > 0$ e $\dfrac{\Delta_k}{\|\nabla f\|} \leq \dfrac{\|\nabla f\|^2}{\nabla f^t B_k \nabla f}$.

Neste caso, $(*)$ fornece $t_k = \dfrac{\Delta_k}{\|\nabla f\|} \leq \dfrac{\|\nabla f\|^2}{\nabla f^t B_k \nabla f}$, donde segue que $t_k^2 \nabla f^t B_k \nabla f \leq t_k \|\nabla f\|^2 = \|\nabla f\| \Delta_k$. Daí

$$m(0) - m(d^k) \geq \|\nabla f\| \Delta_k - \frac{1}{2} \|\nabla f\| \Delta_k = \frac{1}{2} \|\nabla f\| \Delta_k. \quad (2)$$

CASO 3: $\nabla f^t B_k \nabla f > 0$ e $\dfrac{\Delta_k}{\|\nabla f\|} > \dfrac{\|\nabla f\|^2}{\nabla f^t B_k \nabla f}$.

De $(*)$ vem $t_k = \dfrac{\|\nabla f\|^2}{\nabla f^t B_k \nabla f}$ e logo

$$m(0) - m(d^k) = \frac{\|\nabla f\|^4}{\nabla f^t B_k \nabla f} - \frac{1}{2} \cdot \frac{\|\nabla f\|^4}{\nabla f^t B_k \nabla f} = \frac{1}{2} \frac{\|\nabla f\|^4}{\nabla f^t B_k \nabla f}.$$

Pela desigualdade de Cauchy-Schwartz, temos $\nabla f^t (B_k \nabla f) \leq \|\nabla f\| \cdot \|B_k \nabla f\| \leq \|B_k\| \cdot \|\nabla f\|^2$. Assim,

$$m(0) - m(d^k) \geq \frac{1}{2} \frac{\|\nabla f\|^4}{\|B_k\| \cdot \|\nabla f\|^2} = \frac{1}{2} \|\nabla f\| \cdot \frac{\|\nabla f\|}{\|B_k\|} \quad (3)$$

Finalmente, de (1), (2) e (3) chegamos ao resultado ■

Observações:

1) O passo de Cauchy, apesar de ter baixo custo computacional, fornece um método lento próximo à solução pois a direção $d^k = -t_k \nabla f(x^k)$ é similar à do método do gradiente.

2) Note que a informação em B_k não é usada na direção (que é paralela à $-\nabla f(x^k)$). B_k é usada apenas para escalar $-\nabla f(x^k)$ (cálculo de t_k). Essa deficiência fica evidente para $B_k = \nabla^2 f(x^k)$, pois o modelo com essa B_k e "d livre" remonta ao

método de Newton, que é muito mais rápido que o método do gradiente.

3) Portanto é razoável aproveitar B_k ao máximo, idealmente no estilo Newton / Quase-Newton. O próximo método procura fazer isso!

Método dogleg

Neste método, a solução aproximada d^k do modelo $\min_d m(d)$ s.a. $\|d\| \leq \Delta_k$ aproveita melhor B_k. Ele se aplica à B_k definida positiva e simétrica (opções para tal B_k em aula anterior). Quando é possível $B_k = \nabla^2 f(x^k)$, o passo do método dogleg coincide com Newton caso a direção Newtoniana satisfaça $\|d\| \leq \Delta_k$.