**第4章 超越梯度下降**

第3章介绍了梯度下降法。梯度下降法基于函数局部一阶特性。一阶近似是粗糙的，这种粗糙带来了一些问题。本章将介绍函数在局部的二阶特性。基于二阶特性分析函数在局部的性质。

本章首先回顾一些矩阵的相关知识，之后介绍如何在局部对函数进行二阶近似。有了函数的二阶近似就可以确定驻点的类型：极小点、极大点或者鞍点。之后本章介绍对原始梯度下降法的一些改进，这些改进有助于提高收敛速度，防止震荡或发散，规避局部极小。

最后，本章介绍两个基于函数二阶特性的优化算法：牛顿法和共轭方向法。然后介绍用牛顿法训练逻辑回归模型。二阶算法虽然不常用在神经网络和深度学习的训练中。阅读完本章，读者应该对函数的局部形态有更深刻的理解。

**4.1 矩阵**

首先回顾一下矩阵。这不是一个关于矩阵的全面介绍，例如行列式这个概念就没有出现。本节只介绍一下后文讨论中用得上的相关知识。

**4.1.1 矩阵基础**

矩阵是实数构成的2维阵列。以一个矩阵为例：

（4.1）

式（4.1）囊括了本书用到的对矩阵的各种表示。本书用大写粗斜体字母表示矩阵，例如。是矩阵的第行、第列元素。是矩阵的第列，它是一个列向量：

（4.2）

是矩阵的第行，它是一个列向量：

（4.3）

式（4.1）中对进行了转置，以表示一行。矩阵的行数和列数不一定相等，可以是，。表示成：

（4.4）

一般可省略下标。两个相同形状的矩阵可以相加：

（4.5）

矩阵相加就是把相应元素相加。可以用实数（标量）乘一个矩阵：

（4.6）

就是。显然有。是所有元素都为0的矩阵——零矩阵。矩阵的转置定义为：

（4.7）

把的行当做列，列当做行。如果是的，那么就是的。如果矩阵是的，它可以与一个维向量相乘：

（4.8）

矩阵乘向量，使用的元素对矩阵的列进行线性组合。所以的列数和的维数必须相同。得到的结果是一个维向量。容易看出的第个元素是，即的第行与的内积。

有了矩阵和向量相乘的定义，就可以定义矩阵与矩阵相乘：

（4.9）

与的乘积是矩阵。的第列是与的第列的乘积。如果是的，那么必须是维向量，即必须为行。的列数任意，例如。所以要能够与的相乘，的形状必须是，任意。结果的形状是。的第行、第列元素是：

（4.10）

仅从形状上看与不一定能够相乘，因为不一定等于。就算，也不一定等于。即矩阵乘法不满足交换律。一个反例就可以证明这一点。这里不再赘述。

矩阵的乘法满足结合率：

（4.11）

矩阵乘法对加法满足结合律：

（4.12）

矩阵乘法对数乘满足：

（4.13）

矩阵的数乘满足分配率：

（4.14）

矩阵乘积的转置是：

（4.15）

上述几个规则的证明很简单，只需要检查一下矩阵元素的表达式。向量的转置可以乘一个矩阵：

（4.16）

把列向量和行向量分别看作和的矩阵，则矩阵与向量的乘法也满足上述几个规则。

行数和列数相同的矩阵是方阵。方阵的对角线元素之和称为它的迹（trace）：

（4.17）

方阵和的乘积的迹等于的迹，因为**：**

（4.18）

如果一个的方阵的对角线元素为1，其余元素都是0，那么它是单位阵：

（4.19）

容易验证对于任何矩阵，。在上下文很清晰时一般省略的下标。

**4.1.2 矩阵的逆**

令是方阵，如果存在方阵满足：

（4.20）

则称是可逆的。是的逆矩阵。的逆矩阵是唯一的。因为假如任何一个矩阵是的逆矩阵，根据定义有：

（4.21）

如果可逆则的列线性独立。因为假如线性相关，则存在一组不全为0的系数，使得。即存在向量（这里就是，本书约定用脚标表示向量或矩阵元素）使：

（4.22）

因为可逆，存在：

（4.23）

这与矛盾。所以可逆矩阵的列一定线性独立。如果方阵的逆矩阵是，则称为正交矩阵：

（4.24）

从（4.24）可以看出的列是单位向量且两两正交：

（4.25）

也就是说，正交矩阵的列都是单位向量，。任意两列是正交的（夹角为）。因为可逆，所以线性独立，是维线性空间的一组基。因为两两正交，还是单位向量，所以它们被称为的一组标准正交基。

如果一组向量是线性独立的，可以通过施密特正交化过程构造一组正交的向量。构造过程是，首先令。然后令：

（4.26）

是与的夹角。是减去向的投影。与线性独立，它不是的数乘，所以不是零向量。而且容易验证与正交。再令：

（4.27）

是与的夹角，是与的夹角。是减去向和张成空间的投影。如果，那么就可以被和线性表出，也就可以被和线性表出，这与线性独立矛盾。故。容易验证正交于和。此过程继续下去，最终可构造一组正交向量。这就是施密特正交化过程。将的每一个向量除以各自的模，缩放到长度为1，就得到了一组正交的单位向量。

**4.1.3 特征值与特征向量**

特征值和特征向量的概念不局限于方阵，但本书主要关注方阵。用方阵乘向量是在中进行一个变换，将变换成。例如矩阵：

（4.28）

用乘向量等于将逆时针旋转度。这可以自行验证。任何方阵也改变不了零向量，因为。如果对于某非零向量，只能改变的长度而不能改变其方向，即存在某个标量（可以为0），有：

（4.29）

则称是的特征值，是的对于的特征向量。同一个特征向量不可能对应两个特征值。假如都有是其特征向量：

（4.30）

且，所以式（4.30）是不可能的。但是同一个特征值可以对应多个特征向量。如果是对应的特征向量，容易验证也是对应的特征向量。线性独立的两个向量也有可能是同一个特征值对应的特征向量。

假如对应的特征向量和是线性独立的，即谁也不是另一个的数乘。那么也是对应的特征向量。这也很容易验证。如果特征值共有个线性独立的特征向量，由它们线性组合而得的向量也是的特征向量。这个线性独立的特征向量张成的维线性空间称为对应的特征空间，其中所有向量都是的特征向量。

将式（4.29）变形。如果是的特征值，它必须满足对某个，有：

（4.31）

因为，所以的列线性相关。求的特征值和特征向量，就是求满足方程（4.31）的和。若要的列线性相关，则的行列式等于0。本书没有涉及行列式，因为行列式与本书主线关系不大，加进来会影响流畅性。读者可以查阅任何一种线性代数教材。是的次方程。它有个根（包括重根和复数根）。即有个特征值（包括重复的以及复特征值）。求得了，就可以再求它对应的特征向量。

矩阵属于不同特征值的特征向量是线性独立的。现在证明这一点。是个不同特征值对应的特征向量。如果它们线性相关，则其中某一个可以被其他线性表出：

（4.32）

因为是的特征向量，所以它不是零向量。那么一定不全为0。另外根据特征值和特征向量的定义：

（4.33）

如果，那么。再加上不全为0，说明线性相关。在情况下我们将问题规模减小了1。如果，有：

（4.34）

于是式（4.34）等于式（4.32），所以有：

（4.35）

因为都是不同的特征值，所以。再加上不全为0，说明线性相关。在情况下我们也将问题规模减小了1。这个过程持续下去，最终将只剩下两个向量和。他们分属不同的特征值和。且和线性相关，其中一个是另一个的数乘。不妨假设，则也是的特征向量。之前已经证明，一个向量不可能同时属于两个不同特征值。这就推翻了最早的假设，证明了线性独立。

**4.1.4 对称矩阵的谱分解**

如果方阵满足:

（4.36）

如果的元素都是实数，则它是一个实矩阵。实矩阵的特征值都是实数，特征向量是实向量。为了证明这个结论，我们需要暂时离开实数域。

复数的共轭是。

（4.37）

只有当，即时，才有。否则。对于两个复数和，有：

（4.38）

把复矩阵的元素全都取共轭就得到的共轭。如果（复数）和（复向量）是的特征值及对应特征向量，由式（4.38）容易看出：和是的特征值及对应特征向量。

（4.39）

因为是实对称矩阵，有，所以有：

（4.40）

因为，根据式（4.37）。所以，即是实数。是实矩阵，是实数，所以一定是实向量。这就证明了实对称矩阵的特征值都是实数，特征向量是实向量。后文谈到矩阵都是实矩阵。

所以实对称矩阵有个实特征值（可重复）。有一个结论我们不加证明：如果是的重特征值（方程的重根），则对应的特征空间是维，即对于能找到个线性独立的特征向量。

对于对称矩阵，求得它的个特征值，从大到小排列。对每个特征值找到一个它的单位特征向量。如果某个特征值是重，那么找到它的个线性独立的特征向量，经过施密特正交化过程，再缩放到长度为1。这样，一共找到个单位特征向量。可以证明这个特征向量是线性独立的。因为假如它们线性相关，则存在一组不全为0的参数满足：

（4.41）

如果个特征值共有种不同取值，把属于同一个取值的特征向量归到一起：

（4.42）

是属于第个排重特征值（一共排重特征值）的特征向量下标集合。式（4.42）中每一个是对第个排重特征值的特征向量的线性组合，它仍然是第个排重特征值的特征向量。不可能所有都是零向量。因为存在某个非0的且，这与线性独立产生矛盾。这些非零的加在一起是零向量，又与属于不同特征值的特征向量线性独立矛盾。所以是线性独立的。

对称矩阵属于不同特征值的特征向量是正交的。如果和是的两个不同特征值，和是特们各自的特征向量，有：

（4.43）

式（4.43）多次用到了特征值/特征向量的定义，以及标量的转置还是该实数本身。注意观察式（4.43）那些计算结果是标量。

根据式（4.43），有：

（4.44）

因为，所以必有。

的属于同一个特征值的特征向量已经经过施密特正交化，它们彼此正交。刚刚证明了属于不同特征值的特征向量是正交的，所以是线性独立、两两正交的单位向量。用它们作为列，构造矩阵：

（4.45）

是正交矩阵。用的特征值构造对角矩阵：

（4.46）

的个对角线元素是从大到小排列的特征值。其余元素是0。有：

（4.47）

因为，所以有：

（4.48）

这就是对称矩阵的谱分解。

**4.1.5 二次型**

对于某个方阵（不一定对称）：

（4.49）

称作一个二次型。例如：

（4.50）

二次型只包含二次项，不包含一次项、常数（零次）项以及更高次项。这种情况称为是齐次的。从（4.50）可以看出，也可以写成：

（4.51）

将“交叉”项（二元情况下就是）的系数对半分，任何一个二次型都能写成关于对称矩阵的二次型。

一个对称矩阵，如果对于任何向量都有：

（4.52）

则称是半正定的（positive semidefinite）。如果不等号是严格的（），则是正定的（positive definite）。相应地还有半负定（negative semidefinite）和负定（negative definite）。半正定矩阵的所有特征值都不为负，因为假如一个负数特征值，那么可以分解为：

（4.52）

因为是正交矩阵，根据正交矩阵的定义，也是正交矩阵。的列是的基，即存在使得。那么有：

（4.53）

这与的半正定性矛盾。所以半正定矩阵的所有特征值都非负。同样可以证明正定矩阵的所有特征值都为正。半负定矩阵的所有特征值都非正以及负定矩阵的所有特征值都为负。

半正定矩阵可以分解成两个矩阵的乘积：

（4.54）

如果限定是单位向量，则半正定矩阵的二次型的最大值是的最大特征值，达到这个最大值的是的某一个单位特征向量：

（4.55）

是正交矩阵，是任意向量，审视的模：

（4.66）

即用正交矩阵去变换任意向量，不改变向量的长度。从几何角度理解，正交矩阵的行是标准正交基。用正交矩阵乘一个向量相当于将该向量投影在新的标准坐标系中，所以长度不发生改变。

令是对半正定谱分解得到的对角阵，对于任意单位向量，有：

（4.67）

显然在限制下，当且，也就是时式（4.67）达到最大。如果，则。所以当是的最大特征值对应的某个单位特征向量时，

取得最大值。

问时次大的值没有意义。二次型是连续的，当无限接近，可以无限接近。我们加上一个限制条件：须与正交。有结论：

（4.68）

在模为1并正交于约束下，的最大值是的第二大特征值。取的某个单位特征向量时达到此值。证明这个结论，回顾式（4.67），正交于的约束使的第一个元素为0。那么令式（4.67）最大就是把所有“量”都分配给的第2个元素，因为它对应的系数是第二大特征值。所以，即。

总结一下：半正定矩阵的最大特征值对应的单位特征向量，在的约束下使达到最大值；的第二大特征值对应的单位特征向量，在且正交于的约束下使达到最大值；的第三大特征值对应的单位特征向量，在且正交于和的约束下使达到最大值。依次类推。

这个结论在后文介绍主成分分析和导致梯度下降发生震荡的损失函数病态形态时都有用处。

**4.2 多元函数局部二阶特性与驻点的类型**

第3章讲到：梯度为零向量的点——驻点，是局部极小/大点的必要条件。但是紧靠一阶梯度信息，无法判断驻点的具体类型。要做到这一点，就要分析函数在驻点附近的二阶特性。

**4.2.1 赫森矩阵**

元函数在点的赫森（Hessian）矩阵是矩阵:

（4.69）

表示先求对求偏导，再对求偏导，即的二阶偏导。这些二阶导数是在点计算，应记作。文中为了清晰省略自变量。有一个结论本书不给出证明：如果和都是连续的，则它们相等。在本书考虑的问题中这种连续性要求都是满足的。所以是一个对称矩阵。

赫森矩阵的第一行是。它的个元素是对的偏导。这个行向量是函数的梯度的转置。

**4.2.2 二阶泰勒展开**

前文我们知道函数在沿着方向的方向导数是。当限制在一个方向上，可以把看做一元函数，方向导数就是该一元函数的导数。那么当然也存在沿着方向的二阶导数，即导数的导数。首先我们需要求的梯度：

（4.70）

其中是的第列。对的偏导数是的第列与的内积，所以在的梯度是：

（4.71）

所以沿方向的方向导，也就是沿方向的二阶导是：

（4.72）

结论是在沿着方向的二阶导数是二次型。回忆一下一元函数的二阶泰勒展开（一元微积分是本书的先导知识，故涉及一元微积分的结论直接使用）：

（4.73）

余项是的高阶无穷小：

（4.74）

二阶泰勒展开可以扩展到多维：

（4.75）

是在的梯度，是在的赫森矩阵。是的高阶无穷小：

（4.76）

因为任何一个都可以看作是自变量从出发，沿着方向变化了距离。将视为关于一个标量的一元函数，利用一元函数的二阶泰勒展开，有：

（4.77）

当变化距离趋近于0时，余项也趋近于0，且比距离的平方消失得更快（的高阶无穷小）。这就证明了式（4.75）。

式（4.75）右边刨除余项的部分：

（4.78）

是关于向量的二次函数。注意不是二次型。二次型只包含二次项，而包含常数（零次）项、一次项以及二次项。二次函数的典型图像如图4-1。

图4-1 二次函数的典型图像

的图像过。将的图像平移，使移动到。平移后的图像是在附近的二阶近似。的前两项是仿射函数。它的全部信息包含在的梯度中。它是的一阶近似。所以，二阶泰勒展开是对原函数精细到二阶的近似。误差信息包含在余项中。函数的局部一阶特性包含在梯度中，局部二阶特性包含在赫森矩阵中。如图4-2所示。

图4-2 函数的局部二阶近似

**4.2.3 驻点的类型**

驻点到底是局部极小点，局部极大点或鞍点，这些信息一定程度上包含在函数的局部二阶特性中。假如是的驻点。令是在的赫森矩阵。因为有，根据二阶泰勒展开，离开的变化量为的点的函数值是：

（4.79）

令是与同方向的单位向量。假如是正定的，有。是的高阶无穷小。所以当，式（4.79）右边后两项有：

（4.80）

所以当足够靠近时，有。是局部极小点。注意，赫森矩阵必须为正定。如果仅仅是半正定，那么式（4.90）的极限只能是大于等于0，那么自变量顺着某个方向可以从负侧接近0，不能保证局部极小。类似地，如果是负定的，是局部极大点。

正定矩阵特征值都为正，负定矩阵所有特征值都为负。如果特征值有正有负，则矩阵是不定的。如果不定，则沿着正特征值的特征方向二阶导数为正，函数向上翘；沿着负特征值方向，函数向下弯。此时在任何领域内，都有函数值大于的点，也有函数值小于的点，是一个鞍点。如图4-3所示。

图4-3 驻点的类型与赫森矩阵的关系

总结如下：

* 驻点的赫森矩阵正定，是局部极小点；
* 驻点的赫森矩阵负定，是局部极大点；
* 驻点的赫森矩阵不定，是鞍点；
* 驻点的赫森矩阵半正定但非正定，或半正定但非负定，的性质无法确定；

如果不考虑最后一种情况，那么只有当赫森矩阵是正定的，也就是其特征值全部大于0时，驻点是局部极小点。在没有任何先验知识时可以假设特征值大于0的概率是0.5且彼此独立。那么如果模型有个参数，则损失函数的赫森矩阵的特征值全部大于0的概率是。这是一个极小的概率。所以在例如神经网络或深度学习这种参数很多的模型中，局部极小点应该是很罕见的。

函数的局部二阶特性提供了比一阶特性更多的信息。但如果赫森矩阵只是“半定”的，则仍然没有足够的信息完全判断驻点性质，这时就需要更精确的近似。

在梯度下降法中，梯度反方向虽然是下降最快的方向，但如果知道且绝对值很大，则沿着方向，（方向）导数上升且升得很快。这时步长如果较大，则有可能一步之后函数值不降反升。如果在选择前进方向时不仅参考梯度，也参考赫森矩阵，优化算法能做出更优的选择。后文将要讲解的牛顿法和共轭方向法就是如此。

**4.2.4 条件数与病态峡谷**

令，是一个二元二次函数：

(4.81)

其中，，。的梯度是：

（4.82）

的赫森矩阵是：

（4.83）

的二阶泰勒展开就是它自身，余项为0。即二次函数的二阶泰勒展开就精确地是它自身。二次函数的赫森矩阵是常矩阵，它的二阶特性是处处相同的。

现在假设的是正定的，它的所有特征值为正。容易验证可逆。的逆矩阵是：

（4.84）

是的谱分解。

因为可逆，所以的唯一驻点是是一个局部极小点。在驻点上梯度为，则沿任意方向的方向导数为0。但是因为正定，所以在沿任意方向的二阶导是，也就是沿任意方向的方向导数持续增大，过之前为负，过之前为正。也就是沿任意方向，都是先下降，在降到最低然后上升。的图像呈碗状。因为是唯一的局部极小点，所以它是的全局最小点。

的图形沿任意方向都是两端上升的抛物线，但上升的速度不一样。二阶导较大的点，方向导变化较快，沿该方向的抛物线上升更快；二阶导较小的点，方向导变化较慢，沿该方向的抛物线上升更慢。

使二阶导最大的单位向量是的最大特征值对应的特征向量。在此方向上具有最大的二阶导。垂直于且使二阶导最大的单位向量是的次大特征值（在二元函数情况下就是最下特征值）对应的特征向量。在此方向上具有最大的二阶导。

称为的条件数。条件数越大，最大特征值与最小特征值之比越大，在最大特征值的特征方向上函数图像的弯曲程度比垂直于该方向上函数图像的弯曲程度就更加剧烈。所以二次函数的赫森矩阵的条件数越大，则函数图像成越狭长的峡谷。这时候称二次函数的图像是病态的。反之若，则函数图像超各个方向的弯曲程度是相同的，图像成完美的碗状。如图4-4所示。

图4-4 条件数与二次函数图像的狭长程度

狭长的峡谷称为病态的，它对梯度下降算法尤其不利。在第3章中已经看到在这种情况下，不合适的步长会引发震荡甚至不收敛。现在我们从某一个角度提供一个洞见。如果的条件数是1，则，令它们都等于。则有：

（4.85）

那么在的驻点是：

（4.86）

从任意点指向驻点的“箭头”是：

（4.87）

而在的负梯度是：

（4.88）

式（4.98）的含义是，在任一点，其梯度正指向朝着的方向。于是每一步梯度下降都是朝着正确的方向前进。当然如果步长过大，有可能一步跨过**，**发生震荡。步长更大时，仍有可能发生不收敛。

现实中损失函数作为参数值的函数不是二次的，但是在驻点附近二次函数是很好的近似。本节分析的二次函数的特性，可以近似地表示任何函数在局部的特性。

**4.3 基于函数二阶特性的优化**

如果参考函数二阶特性信息，则优化过程会更有效率。但是高维情况下赫森矩阵的计算量是巨大的，这妨碍了二阶优化算法在神经网络或深度学习中的应用。人们提出了一些节省计算量的近似二阶算法，本书不对其进行讨论。本节介绍两个基于赫森矩阵的优化算法——牛顿法和共轭方向法，并探讨它们的几何意义。

**4.3.1 牛顿法**

牛顿法的思想是：在某点附近对函数进行二阶泰勒展开，之后求函数的近似二次函数的驻点，以该点为下一个点，迭代地进行此步骤。根据式（4.75），离开一个变化量的函数值的二次近似函数是：

（4.89）

的梯度是：

（4.90）

如果的特征值都非0，则利用式（4.84）可以构造它的逆矩阵。特征值取某个特定值，例如0的概率很低，也就是绝大部分情况下都可以认为是可逆的。令，解得的驻点是：

（4.91）

所以，牛顿法对自变量的迭代更新量就是。牛顿法伪代码如下：

randomly initialized

while :

与梯度下降法一样，是一个预设的阈值，当时认为已经足够接近零向量，算法停止。也可以采用循环次数达到预设的最大值，或者函数值的下降幅度小于阈值等停止标准。

梯度下降法，向着反梯度方向更新自变量。而牛顿法将乘上了赫森矩阵的逆矩阵。假设是正定的，根据对称矩阵的谱分解，可以分解成：

（4.92）

是由的特征向量构成的正交矩阵。是从大到小排列的的个特征值（可重）。牛顿算法的更新量可以写成：

（4.93）

的列（的行）是的一组标准正交基，也就是一个坐标系。该坐标系的第一个轴沿着二阶导最大的方向；第二个轴沿着垂直于第一个轴且二阶导第二大的方向。向量相当于对做了一次旋转。如果忽略矩阵，是将旋转过去又旋转回来。

加上的作用后，相当于用惩罚的各个特征方向上的分量。特征值越大，其对应的特征方向上的二阶导越大。越小，则对在该特征方向上的分量惩罚越严厉。还记得狭长峡谷中梯度下降法的震荡发生的原因，就是二阶导较大的方向主宰了梯度方向，导致算法没有想着理想的局部极小点方向前进。牛顿法通过对二阶导最大的方向进行适当惩罚，缓解了这种现象。如图4-5所示。

图4-5 牛顿法相当于对二阶导过大的方向进行惩罚

如果函数本身是二次函数，它的二阶泰勒展开就是它自身。牛顿法可以直接定位到二次近似的驻点。也就是说对于二次函数，牛顿法一步迭代就能寻找到它的唯一驻点——全局最小点。

**4.3.2 共轭方向法**

二次函数的赫森矩阵是常矩阵，假设正定。任意选择一点，在其附近将二次函数泰勒展开：

（4.94）

利用式（4.94）可以求的梯度：

（4.95）

式（4.95）表示对于二次函数，任意两点和的梯度之差等于用赫森矩阵对它们的差进行变换。

本节假设二次函数的赫森矩阵是正定的。如果单位向量和满足：

（4.94）

则称和关于共轭。注意式（4.94）第一个等式是必然成立的。因为是标量，它等于它的转置：。和关于共轭，要求这个值为0。共轭其实是要求一个向量经过的变换后与另一个正交。如果的所有特征值都相同，则和关于共轭就是和正交：

（4.95）

要优化一个赫森矩阵正定的二次函数，共轭方向法在空间中寻找个两两之间关于共轭的单位向量。从任意一点开始，在直线上寻找使最小的点。然后从开始，在直线上寻找使最小的点。此过程持续下去，知道找到。就是的全局最小点。后文会证明这一点。

我们首先看看如果沿着过并沿着方向的直线上寻找使最小的点。令函数。在点对泰勒展开，有：

（4.96）

根据式（4.96），是一个二次函数。它对的导数是：

（4.97）

对的二阶导数是：

（4.98）

因为之前假定正定，所以的二阶导大于0。于是的唯一驻点就是它的全局最小点。通过置式（4.97）为0，可以求得的驻点是：

（4.99）

在点导数为0，即在点沿的方向导数为0：

（4.100）

共轭方向法从任意点开始，沿着直线寻找最小点，根据式（4.99）：

（4.101）

另根据式（4.100），有。以此作为数学归纳法的其实条件。如果我们已经找到，有：

（4.102）

现在从开始沿直线寻找最小点。直线上任意一点沿之前个方向的方向导数是：

（4.102）

式（4.102）利用了式（4.95）以及与关于共轭。在上使达到最小的点是：

（4.103）

以上结论是说，从任意点出发沿着第一个共轭方向寻找到最小点。之后沿着第二个方向寻找最小点，而且在此过程中沿第一个方向的方向导为0，也就是说仍能保证沿第一个方向函数值达到最小。后续沿某一个方向寻找最小点时，能保证沿之前的方向仍保持是最小点。

还需要证明最终的是在整个空间中的全局最小点。如果一组向量是关于的，那么它们一定线性独立。因为假如存在一组系数使，对任意，有：

（4.104）

式（4.104）利用了两两共轭的事实。因为正定，有，于是必有。这对于任意都成立，所以线性独立。它们构成的一组基。偏离产生任意一个位移，都可以分解成沿的运动，这这些运动都将使增大。所以是的全局最小值。

还剩下一个问题，如何寻找一组关于共轭的单位向量。是的一组正交标准（模为1）特征向量。对于任意和，有：

（4.105）

所以就是一组关于共轭的单位向量。共轭方向法的伪代码如下：

random point

are orthogonal unit eigenvectors of hessian matrix

for in 1 to :

return

对于非二次函数，可以在某一点对它的局部二次近似施加共轭方向法以确定该二次拟合的最小点。然后再从该点出发再次执行共轭梯度法。