

Técnicas amostrais para otimização não suave: convergência e resultados práticos

Lucas Eduardo Azevedo Simões (Unicamp), Elias Salomão Helou (ICMC-USP), Sandra Augusta Santos (Unicamp)

Resumo/Abstract:

Problemas de minimização envolvendo funções não suaves estão presentes em várias áreas da ciência. Quando a função objetivo é convexa, técnicas de "Bundle" são uma ferramenta importante na solução de tais problemas, entretanto, quando a convexidade não está presente, estes métodos tornam-se pouco intuitivos. Como alternativa, técnicas amostrais vêm sendo desenvolvidas para a minimização de tais funções. Neste estudo, apresentamos métodos amostrais recentes e discutimos suas limitações, velocidades de convergência e alguns resultados práticos.