

Uma aplicação da otimização convexa em estimação de quadrados mínimos

Lucas Monteiro Chaves ¹³

Resumo: A otimização de funções convexas com restrições também convexas é uma teoria com aplicabilidade em várias áreas teóricas e aplicadas. Serão apresentadas uma revisão dos resultados básicos da teoria, a construção da função dual de Lagrange e soluções de alguns problemas clássicos. Finalmente será apresentada uma aplicação em Estatística, a construção de um estimador de quadrados mínimos penalizado denominado LASSO.

¹³Universidade Federal de Lavras,
lucas@dex.ufla.br