

拉格朗日——牛顿法的一个局部超线性收敛算法

李树冬[1] 桂胜华[2]

(【1】上海商学院基础教学部, 上海200235 [2]上海第二工业大学理学院, 上海201209)

中图分类号: 0221.2

摘要: 桂胜华等曾提出含弱互补函数的不等式约束最优化问题的拉格朗日—牛顿法和拟牛顿法, 但算法中计算Hesse矩阵的工作量较大, 且该算法仅能解不等式约束最优化问题. 论文改进了桂胜华等的算法, 用拟牛顿公式代替了Hesse矩阵, 并把解不等式约束最优化问题推广到既含不等式约束又含等式约束最优化问题; 证明了此算法具有全局收敛性和局部超线性收敛性.

关键词: KKT点 拟牛顿法 约束非线性规划 超线性收敛

 [阅读文章\(pdf\)](#)

关闭本页