

有界变量约束优化的仿射投影共轭梯度路径内点方法

林涛, 朱德通

(上海师范大学数理信息学院, 上海200234)

中图分类号: 0221.2

摘要: 采用共轭梯度路径结合仿射内点投影回代技术解有界变量约束的非线性优化问题. 通过构造共轭梯度路径解二次模型获得搜索方向, 引入线搜索技术获得的迭代步既落在严格可行域内, 又能使目标函数下降. 基于共轭梯度路径的性质, 在合理的假设条件下, 证明了所提供的算法不仅具有整体收敛性, 而且保持快速的超线性收敛速率. 进一步, 数值计算说明了算法的可行性和有效性.

关键词: 有界变量约束;;共轭梯度路径;;内点法;;仿射投影

 [阅读文章\(pdf\)](#)

关闭本页