

# 约束优化的两块校正非单调回代法(英文)

顾益明, 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:** 提出一种两块校正既约Hessian方法的非单调信赖域回代算法来解决约束优化问题。一般采用两块校正的双边既约Hesse阵方法代替完全Hesse阵方法处理大规模问题。为了获得算法的整体收敛性,引入非光滑的 $l_1$ 罚函数作为势函数。在每次回代中不必使罚函数都单调递减,以使能克服高度非线性情况下的峡谷状态,同时采用二阶校正步计算能避免Maratos效应。只要每一步迭代至少运用两种校正规则之一,算法就能保持一步局部 $Q$ -超线性收敛速率。

**关键词:** 非单调技术;;两块校正;;超线性收敛

 [阅读文章\(pdf\)](#)

关闭本页