

论文

二阶修正的约束变尺度算法

赖炎连(1), 贺国平(2)

(1)中国科学院应用数学研究所;(2)中国科学院应用数学研究所

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 我们知道,70年代发展起来的约束变尺度算法是求解非线性规划问题的十分有效的方法之一. 它的特点是初始点可任取且有快速的收敛速度.若我们考虑如下的非线性规划问题:

关键词

分类号

A CONSTRAINED VARIABLE METRIC ALGORITHM WITH SECOND ORDER CORRECTIONS

LAI YAN-LIAN(1),HE GUO-PING(2)

(1)Institute of Applied Mathematics,Academia Sinica;(2)Institute of Applied Mathematics,Academia Sinica

Abstract A linear search technique different from Fukushima's is adopted and the solution of quad-ratic programming is combine with second order corrections,to give a new constrained varia-ble metric algorithm.The global convergence of the algorithm and local superlinear conver-gence rate are proved.The algorithm does not necessarily need to solve two quadraticprogrammeng subproblems at each step.Thus it can save a lot of calculations and avoidthe Maratos effect.

Key words

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(427KB\)](#)

▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [复制索引](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 无 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [赖炎连](#)

· [贺国平](#)