

Metody s proměnnou metrikou s omezenou pamětí, využívající hodnot z předchozí iterace

Jan Vlček, Ladislav Lukšan

Ústav informatiky AV ČR, Praha

Je navržena třída metod s proměnnou metrikou s omezenou pamětí pro nepodmíněnou minimalizaci, využívající hodnot z předchozí iterace, založená na obdobném kvazi-součinném tvaru aktualizace, jako široce používaná metoda L-BFGS. Nové metody používají stejný počet násobení matice vektorem a stejný počet vektorů jako metoda L-BFGS a jsou globálně konvergentní. Numerické výsledky ukazují, že pro některé třídy úloh to může významně zlepšit efektivitu.