



C I E M

Optimización no lineal usando la función Lagrangiana aumentada

Resumen:

La función Lagrangiana aumentada fue introducida para mejorar el desempeño de un método numérico. Su posterior estudio se ha usado para reinterpretar los multiplicadores de Lagrange, estudiar condiciones de regularidad y caracterizar condiciones de optimalidad de segundo orden, entre otros. En esta charla mostraremos algunas propiedades analíticas de esta función y las repercusiones de este análisis en el desarrollo de algoritmos..