

<<二次规划>>

图书基本信息

书名：<<二次规划>>

13位ISBN编号：9787307049642

10位ISBN编号：7307049643

出版时间：2006-4

出版时间：武汉大学出版社

作者：张忠桢

页数：228

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<二次规划>>

内容概要

《二次规划：非线性规划与投资组合的算法》结构严谨，深入浅出，所有算法都有相应的定理为基础。

为便于初学者掌握，仅用到一些较基本的数学知识，并且大多数问题有简单的例子说明算法的计算步骤。

阅读本书只需具备线性代数、概率论和微分学的一些基础知识。

本书可作为应用数学、经济学、管理科学以及许多工程技术学科研究生的教材或教学参考书。

涉足运筹学优化的教师和研究人员更应该知道非线性规划特别是一些较为简单的非线性规划如何计算

。

<<二次规划>>

作者简介

张忠桢，1946年4月生，湖北武汉人。
1970年3月清华大学机械系本科生毕业，1980年12月华中科技大学系统工程专业硕士生毕业，1988年10月至1989年10月先后在英国约克大学经济系和伦敦泰晤士理工学院数学和统计系进修，现为武汉理工大学管理学院教授、博士生导师。
1992年出版专著《线性方程组和线性规划的新算法》，1996年与张南纶合著《中国宏观经济归纳分析》，2004年出版专著《凸规划——投资组合与网络优化的旋转算法》，发表论文三十多篇。

<<二次规划>>

书籍目录

第一章 基础知识1.1 矩阵的旋转运算及分块矩阵公式1.2 向量与矩阵的范数及其性质1.3 凸锥及Farkas引理1.4 约束最优化及Kuhn—Tucker条件1.5 约束最优化的其他一些定理第二章 线性不等式组2.1 基本概念及有关定理2.2 线性不等式组的旋转算法2.3 循环与反循环2.4 参数化技术2.5 线性不等式组的极点解第三章 凸二次规划3.1 二次规划的旋转算法3.2 凸二次规划的计算步骤3.3 变量有上界的凸二次规划第四章 非凸二次规划4.1 二次齐次函数的下降方向4.2 I型和II型非负下降方向4.3 二次齐次函数在锥内的下降方向4.4 非凸二次规划的局部极小点4.5 局部极小点的改进第五章 约束非线性规划5.1 序列二次规划法简介5.2 序列线性规划法5.3 牛顿法5.4 拉格朗日法5.5 增广拉格朗日法5.6 拟牛顿法第六章 均值方差投资组合选择模型的解法6.1 标准均值方差投资组合选择模型6.2 资产有上界限制的均值方差模型6.3 具有交易成本的均值方差模型6.4 自融资均值方差模型6.5 V形交易成本的均值方差模型参考文献

<<二次规划>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>