

Augmented Lagrangian type function and Subgradient Method

Jefferson D. G. De Melo*

*Instituto de Matemática e Estatística da Universidade
Federal de Goiás, Goiânia

Resumo

Apresentaremos um estudo de dualidade via funções do tipo Lagrangiana aumentada. Discutiremos questões relacionadas a dualidade, como brecha de dualidade e solução do problema dual. Em especial, mostraremos que o método do subgradiente pode ser modificado de forma simples para aproveitar a estrutura do problema dual via função Lagrangiana “sharp”. Apresentaremos portanto as principais propriedades deste método, bem como os seus resultados de convergência.