

# BFGS quasi-newton

Algorytm Broydena – Fletchera – Goldfarba – Shanno (BFGS) jest iteracyjną metodą rozwiązywania nieliniowych problemów optymalizacji bez ograniczeń (Fletcher, 1987). Należy do metod quasi-Newtonowskich, w których nie oblicza się macierzy Hessego drugiej pochodnej. Zamiast tego, macierz Hessego jest aproksymowana. Metoda Newtona i metody BFGS nie gwarantują zbieżności chyba, że funkcja ma kwadratową ekspansję Taylora w pobliżu optimum. Jednak BFGS może mieć akceptowalną wydajność, nawet w przypadku wystąpienia optymalizacji, która nie jest ciągła (Curtis and Que, 2015).

Optymalizacja BFGS nie wymaga konfiguracji parametrów