

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Институт вычислительной математики и информационных технологий



УТВЕРЖДАЮ

Проректор по образовательной деятельности КФУ

Проф. Талорский Д.А.

_____ 20__ г.

подписано электронно-цифровой подписью

Программа дисциплины
Методы оптимизации Б1.Б.17

Направление подготовки: 01.03.02 - Прикладная математика и информатика

Профиль подготовки: Системное программирование

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Автор(ы):

Кораблев А.И.

Рецензент(ы):

Андрианова А.А.

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий(ая) кафедрой: Миссаров М. Д.

Протокол заседания кафедры No ____ от " ____ " _____ 201__ г

Учебно-методическая комиссия Института вычислительной математики и информационных технологий:

Протокол заседания УМК No ____ от " ____ " _____ 201__ г

Регистрационный No 934918

Казань
2018

Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. (доцент) Кораблев А.И. кафедры анализа данных и исследования операций отделение фундаментальной информатики и информационных технологий, Anatol.Korablev@kpfu.ru

1. Цели освоения дисциплины

Цель курса: ознакомить студентов с базовыми моделями оптимизационного типа, основными методами их исследования и поиска решений. В числе рассматриваемых классов находятся задачи линейного программирования, включая задачи транспортного типа, решаемые с помощью конечных методов. Для исследования задач нелинейной оптимизации привлекается аппарат выпуклого анализа и условия оптимальности. Излагаются также основные подходы к построению методов минимизации выпуклых функций, в том числе с нелинейными ограничениями. Параллельно изложению проводится решение тестовых задач.

2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел "Б1.Б.17 Дисциплины (модули)" основной образовательной программы 01.03.02 Прикладная математика и информатика и относится к базовой (общепрофессиональной) части. Осваивается на 3 курсе, 5 семестр.

Данная дисциплина относится к общепрофессиональным дисциплинам.

Читается на 3 курсе в 6 семестре для студентов обучающихся по направлению "Прикладная математика и информатика".

Изучение основывается на результатах изучения дисциплин "Алгебра и геометрия", "Математический анализ 1", "Математический анализ 2".

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ОПК-1 (профессиональные компетенции)	способностью использовать базовые знания естественных наук, математики и информатики, основные факты, концепции, принципы теорий, связанных с прикладной математикой и информатикой
ПК-1 (профессиональные компетенции)	способностью собирать, обрабатывать и интерпретировать данные современных научных исследований, необходимые для формирования выводов по соответствующим научным исследованиям

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

- знать основные свойства методов решения задач нелинейной оптимизации.

2. должен уметь:

- решать задачи линейного программирования произвольного вида с помощью симплекс-метода;
- решать транспортные задачи с помощью метода потенциалов.

3. должен владеть:

- навыками использования различных критериев проверки свойств выпуклости функций;

4. должен демонстрировать способность и готовность:

- проверять выполнение условий оптимальности для нелинейной задачи оптимизации;
- выбирать метод решения задач нелинейной оптимизации.

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачетных(ые) единиц(ы) 180 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины экзамен в 5 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Модели задач оптимизации. Постановка задачи математического программирования.	5		2	0	2	Письменное домашнее задание
2.	Тема 2. Постановка задачи линейного программирования. Свойства задачи.	5		4	0	0	Устный опрос
3.	Тема 3. Методы решения задач линейного программирования.	5		6	0	14	Письменное домашнее задание Контрольная работа
4.	Тема 4. Элементы выпуклого анализа. Постановка и свойства задачи выпуклого программирования	5		4	0	2	Письменное домашнее задание

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
5.	Тема 5. Градиент и субградиент функции. Неравенства-следствия.	5		4	0	0	Устный опрос
6.	Тема 6. Методы безусловной минимизации функций.	5		6	0	8	Письменное домашнее задание
7.	Тема 7. Методы условной минимизации функций.	5		8	0	10	Письменное домашнее задание Контрольная работа
8.	Тема 8. Вариационное исчисление и оптимальное управление.	5		2	0	0	Устный опрос
	Тема . Итоговая форма контроля	5		0	0	0	Экзамен
	Итого			36	0	36	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Модели задач оптимизации. Постановка задачи математического программирования.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Введение. История становления и перспективы развития методов оптимизации. Оптимизационные математические модели (критерий оптимальности, ограничения задачи). Примеры математических моделей. Постановка задачи математического программирования. Задачи линейного и нелинейного программирования.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Построение математических моделей прикладных задач (транспортная задача, задача планирования производства, задача о раскрое и др.) в виде задач линейного программирования.

Тема 2. Постановка задачи линейного программирования. Свойства задачи.

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Линейное программирование (ЛП). Постановка задачи ЛП в форме неравенств и ее геометрический смысл. Метод дополнительных переменных. Опорные планы и псевдопланы задачи ЛП. Теорема о соответствии опорного плана и крайней точки допустимого множества. Идеи прямого симплекс-метода. Обоснование возможности перехода от одного опорного плана к другому с уменьшением линейной формы. Теорема оптимальности опорного плана.

Тема 3. Методы решения задач линейного программирования.

лекционное занятие (6 часа(ов)):

Теорема о неограниченности линейной формы на допустимом множестве. Симплексная таблица. Формулы пересчета коэффициентов разложения векторов-столбцов матрицы ограничений. Алгоритм прямого симплекс-метода. Метод искусственного базиса. Модифицированный симплекс-метод(метод обратной матрицы). Пример. Двойственные задачи ЛП и их основные свойства. Двойственный симплекс-метод. Пример. Метод потенциалов для решения транспортной задачи

лабораторная работа (14 часа(ов)):

Решение задач линейного программирования симплексным методом без привлечения искусственных переменных. Решение задач с использованием метода искусственного базиса. Решение задач методом обратной матрицы. Решение задач двойственным симплекс-методом.

Тема 4. Элементы выпуклого анализа. Постановка и свойства задачи выпуклого программирования

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Элементы выпуклого анализа. Выпуклые множества и выпуклые функции. Примеры. Исследование на выпуклость многомерной функции с помощью одномерной функции. Теорема о выпуклости и замкнутости лебегова множества выпуклой функции. Постановка задачи выпуклого программирования (ВП) и ее геометрический смысл. Свойства задачи ВП.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Решение задач из выпуклого анализа (доказательство выпуклости множеств, проверка на выпуклость функций и т. д.)

Тема 5. Градиент и субградиент функции. Неравенства-следствия.

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Градиент функции и его геометрический смысл. Градиентное неравенство. Неравенство для функций, градиент которых удовлетворяет условию Липшица. Неравенства-следствия. Лемма Фаркаша. Критерий оптимальности задачи ВП (в частности, теорема Куна-Таккера). Субградиент функции. Способ вычисления субградиентов для функции максимума.

Тема 6. Методы безусловной минимизации функций.

лекционное занятие (6 часа(ов)):

Методы одномерной минимизации (метод деления отрезка пополам, метод "золотого" сечения). Градиентный метод (метод наискорейшего спуска), метод покоординатного спуска, метод Ньютона, метод сопряженных градиентов для безусловной минимизации гладких функций.

лабораторная работа (8 часа(ов)):

Решение задач безусловной минимизации гладких функций методом наискорейшего спуска, методом покоординатного спуска, методом Ньютона, методом сопряженных градиентов (применение одной или двух итераций методов).

Тема 7. Методы условной минимизации функций.

лекционное занятие (8 часа(ов)):

Общая схема методов возможных направлений для условной минимизации. Полный шаг в методах возможных направлений и способ его вычисления. Метод условного градиента, метод проекции градиента, метод Ньютона, метод возможных направлений Зойтендейка. Метод Лагранжа. Метод штрафных функций. Метод обобщенного градиентного спуска (метод опорных элементов) для условной минимизации недифференцируемых выпуклых функций. Методы отыскания точки выпуклого множества.

лабораторная работа (10 часа(ов)):

Решение задач условной минимизации (с применением одной или двух итераций) методом условного градиента, методом проекции градиента, методом Зойтендейка, методом Лагранжа, методом обобщенного градиентного спуска.

Тема 8. Вариационное исчисление и оптимальное управление.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Постановка задачи вариационного исчисления. Примеры задач вариационного исчисления. Уравнение Эйлера(с обоснованием). Примеры использования уравнения Эйлера. Постановка задачи оптимального управления. Принцип максимума Понтрягина (с выводом). Пример использования принципа максимума. Проблема синтеза.

4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
1.	Тема 1. Модели задач оптимизации. Постановка задачи математического программирования.	5		подготовка домашнего задания	8	домашнее задание
2.	Тема 2. Постановка задачи линейного программирования. Свойства задачи.	5		подготовка к устному опросу	10	устный опрос
3.	Тема 3. Методы решения задач линейного программирования.	5		подготовка к контрольной работе	10	контрольная работа
4.	Тема 4. Элементы выпуклого анализа. Постановка и свойства задачи выпуклого программирования	5		подготовка домашнего задания	8	домашнее задание
5.	Тема 5. Градиент и субградиент функции. Неравенства-следствия.	5		подготовка к устному опросу	8	устный опрос
6.	Тема 6. Методы безусловной минимизации функций.	5		подготовка домашнего задания	10	домашнее задание
	Итого				54	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

Обучение происходит в форме лекционных и лабораторных занятий, а также самостоятельной работы студентов.

Теоретический материал излагается на лекциях. Причем конспект лекций, который остается у студента в результате прослушивания лекции не может заменить учебник. Его цель - формулировка основных утверждений и определений. Прослушав лекцию, полезно ознакомиться с более подробным изложением материала в учебнике. Список литературы разделен на две категории: необходимый для сдачи экзамена минимум и дополнительная литература.

Изучение курса подразумевает не только овладение теоретическим материалом, но и получение практических навыков для закрепления навыков построения математических моделей оптимизационного типа и решения задач оптимизации.

Самостоятельная работа предполагает выполнение домашних работ. Практические задания, выполненные в аудитории, предназначены для указания общих методов решения задач определенного типа. Закрепить навыки можно лишь в результате самостоятельной работы.

Кроме того, самостоятельная работа включает подготовку к экзамену. При подготовке к сдаче экзамена весь объем работы рекомендуется распределять равномерно по дням, отведенным для подготовки к экзамену, контролировать каждый день выполнения работы. Лучше, если можно перевыполнить план. Тогда всегда будет резерв времени.

6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Тема 1. Модели задач оптимизации. Постановка задачи математического программирования.

домашнее задание , примерные вопросы:

Построение математических моделей прикладных задач (транспортная задача, задача планирования производства, задача о раскрое и др.) в виде задач линейного программирования.

Тема 2. Постановка задачи линейного программирования. Свойства задачи.

устный опрос , примерные вопросы:

Опрос по теме "Постановка задачи линейного программирования. Свойства задачи".

Тема 3. Методы решения задач линейного программирования.

контрольная работа , примерные вопросы:

Решение задач линейного программирования симплексным методом без привлечения искусственных переменных. Решение задач с использованием метода искусственного базиса. Решение задач методом обратной матрицы. Решение задач двойственным симплекс-методом. Подготовка к контрольной работе по теме "Методы решения задач линейного программирования"

Тема 4. Элементы выпуклого анализа. Постановка и свойства задачи выпуклого программирования

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач из выпуклого анализа (доказательство выпуклости множеств, проверка на выпуклость функций и т. д.)

Тема 5. Градиент и субградиент функции. Неравенства-следствия.

устный опрос , примерные вопросы:

Опрос по теме "Неравенства-следствия. Лемма Фаркаша. Критерий оптимальности задачи ВП (теорема Куна-Таккера)".

Тема 6. Методы безусловной минимизации функций.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач безусловной минимизации гладких функций методом наискорейшего спуска, методом покоординатного спуска, методом Ньютона, методом сопряженных градиентов (применение одной или двух итераций методов).

Тема 7. Методы условной минимизации функций.

Тема 8. Вариационное исчисление и оптимальное управление.

Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к экзамену:

Билеты для экзамена:

- ◆ 1.
 1. Теорема о соответствии опорного плана и крайней точки допустимого множества (с доказательством).
 2. Метод штрафных функций.
- ◆ 2.
 1. Вывод симплексного метода (Обоснование способа перехода от одного опорного плана к другому).
 2. Решение задачи отыскания точки выпуклого множества.
- ◆ 3.

1. Обоснование возможности перехода от одного опорного плана к другому в симплексном методе с уменьшением линейной формы.
2. Геометрический смысл методов условного градиента и обобщенного градиентного спуска.
- ◆ 4.
 1. Теорема (критерий) оптимальности опорного плана. Доказательство теоремы.
 2. Постановка и геометрический смысл задачи выпуклого программирования. Метод проекции градиента и метод центров для ее решения (без обоснования сходимости).
- ◆ 5.
 1. Симплексная таблица в прямом симплекс-методе.
 2. Метод наискорейшего спуска. Теорема его сходимости (с доказательством).
- ◆ 6.
 1. Метод искусственного базиса (с обоснованием).
 2. Теорема о глобальном и локальном минимуме (с доказательством).
- ◆ 7.
 1. Симплексные таблицы в методе обратной матрицы и способ их пересчета (без обоснования метода).
 2. Теорема сходимости метода обобщенного градиентного спуска (с доказательством).
- ◆ 8.
 1. Лемма о ранге матрицы ограничений транспортной задачи с доказательством. (Привести вид матрицы).
 2. Полный шаг в методах возможных направлений. Его геометрический смысл и способ отыскания.
- ◆ 9.
 1. Метод потенциалов для решения транспортной задачи (с обоснованием).
 2. Метод покоординатного спуска (без обоснования сходимости).
- ◆ 10.
 1. Обоснование способа нахождения вектора, входящего в базис в методе потенциалов.
 2. Метод штрафных функций. Его геометрический смысл.
- ◆ 11.
 1. Алгоритм симплексного метода (без обоснования).
 2. Геометрический смысл субградиента. Отыскание субградиента для функции максимума (с обоснованием способа отыскания). Метод обобщенного градиентного спуска (без обоснования сходимости). Его геометрический смысл и реализация для гладких функций.
- ◆ 12.
 1. Теорема оптимальности (критерий оптимальности) опорного плана (с доказательством).
 2. Общая схема методов возможных направлений (понятия возможного направления, подходящего направления, полного шага). Способы построения подходящего направления в методах условного градиента и проекции градиента.
- ◆ 13.
 1. Опорный план транспортной задачи. Доказательство опорности плана, построенного методом "северо-западного" угла.
 2. Метод наискорейшего спуска и его геометрический смысл. Теорема сходимости метода (с доказательством).
- ◆ 14.
 1. Метод обратной матрицы (без обоснования).
 2. Метод условного градиента. Его геометрический смысл. Теорема сходимости метода (с доказательством).

◆ 15.

1. Модифицированный симплекс-метод (с обоснованием).
2. Способы отыскания точки выпуклого множества.

7.1. Основная литература:

1. Кашина О.А. Методы оптимизации. Часть I. Элементы теории экстремальных задач [Текст] / О.А. Кашина, А.И. Кораблев: - Казань: изд-во КГУ, 2008. - 84 с.
2. Кашина, О. А.. Методы оптимизации: учебное пособие / О. А. Кашина, А. И. Кораблев; Казан. гос. ун-т, Фак. вычисл. математики и кибернетики. ?Казань: Изд-во Казан. гос. ун-та, 2008. ?; 21.
- Ч. 2: Численные методы решения экстремальных задач. ?2011. ?143 с. ?Библиогр.: с. 138-143 (39 назв.), 150 . ?
3. Измаилов А.Ф., Солодов М.В. Численные методы оптимизации. - М.: Физматлит, 2008. - 320с. URL: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=2184
4. Лесин В.В., Лисовец Ю.П. Основы методов оптимизации. - СПб.: Лань, 2011. - 352с. URL: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=1552
5. Сухарев А.Г., Тимохов А.В., Федоров В.В. Курс методов оптимизации. - М.: Физматлит, 2011. - 384с. URL: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=2330

7.2. Дополнительная литература:

1. Васильев Ф.П. Методы оптимизации. Кн.1 - М.: МЦНМО, 2011. - 620 с. ЭБС "Лань": <http://e.lanbook.com/view/book/9304/>
2. Васильев Ф.П. Методы оптимизации. Кн.2 - М.: МЦНМО, 2011. - 433 с. ЭБС "Лань": <http://e.lanbook.com/view/book/9305/>
3. Кашина О.А, Кораблев А.И. Электронный курс "Методы оптимизации", 2011. <http://zilant.kpfu.ru/course/view.php?id=17260>

7.3. Интернет-ресурсы:

- ИССЛЕДОВАНИЕ ОПЕРАЦИЙ И МЕТОДЫ ОПТИМИЗАЦИИ - <http://kek.ksu.ru/EOS/MO/index.html>
- СИМПЛЕКСНЫЙ МЕТОД ЛИНЕЙНОГО ПРОГРАММИРОВАНИЯ - <http://kek.ksu.ru/EOS/Simplex/index.htm>
- СИМПЛЕКСНЫЙ МЕТОД: Режим демонстрации - <http://kek.ksu.ru/EOS/sim/index.html>
- СИСТЕМНЫЙ АНАЛИЗ (архив лекций) - <http://kek.ksu.ru/kek2/os.php>
- СПЕЦ. ГЛАВЫ МАТЕМАТИЧЕСКОГО ПРОГРАММИРОВАНИЯ - <http://kek.ksu.ru/EOS/SGMP/index.html>

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Методы оптимизации" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Лекции и лабораторные занятия по дисциплине проводятся в аудитории, оснащенной доской и мелом(маркером).

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 01.03.02 "Прикладная математика и информатика" и профилю подготовки Системное программирование .

Автор(ы):

Кораблев А.И. _____

"__" _____ 201__ г.

Рецензент(ы):

Андрианова А.А. _____

"__" _____ 201__ г.