

TAOP14 Optimeringslära grundkurs för I2, Ii2

MÅL

Inom optimeringslära behandlas matematiska teorier och metoder som syftar till att analysera och lösa beslutsproblem som uppkommer inom teknik, ekonomi, medicin, etc. Kursen ger, tillsammans med TAOP37 Optimeringslära fortsättningskurs, en bred orientering om optimeringslära, men inriktning mot grundläggande teori och metoder för kontinuerliga optimeringsproblem i ändlig dimension, samt en inblick i dess tillämpning för att analysera praktiska optimeringsfrågeställningar. Efter fullgjord kurs skall studenten:

- kunna identifiera frågeställningar av optimeringskaraktär och att klassificera optimeringsproblem utifrån deras egenskaper, som till exempel i kontinuerliga linjära respektive olinjära problem
- konstruera matematiska modeller av enkla optimeringsproblem
- kunna definiera och använda grundläggande begrepp, som till exempel lokal och global optimalitet, baslösningar, konvexitet, samt svag och stark dualitet
- ha kännedom om och kunna tillämpa grundläggande teori för några vanliga typer av optimeringsproblem, som till exempel dualitetsteori för linjära problem, och ha kännedom om och kunna utnyttja optimalitetsvillkor, som till exempel Karush-Kuhn-Tucker villkoren, för att avgöra optimalitet för ett en föreslagen lösning
- ha kännedom om och kunna tillämpa grundläggande metodprinciper för att lösa några vanligt förekommande typer av optimeringsproblem, som till exempel simplexmetoden för linjära problem
- kunna utnyttja relaxeringar, och speciellt Lagrange-dualitet, för att approximera optimeringsproblem, samt kunna stänga in optimalvärden med hjälp av optimistiska och pessimistiska uppskattningar
- kunna använda vanligt förekommande optimeringsprogramvara för att lösa standardmässiga optimeringsproblem
- ha viss kännedom om tillämpningar av optimeringsmetodik.

FÖRKUNSKAPER

Analys och Linjär Algebra. Lämplig förberedelse för kursen är att repetera vektor/matrisräkning, lösning av ekvationssystem, begreppet bas samt derivator.

TIMPLAN

Kursdel	Föreläsningar	Lektioner	Laborationer
Linjärprogrammering	12h	14h	8h
Ickelinjär programmering	8h	10h	4h

KURSLITTERATUR

Kurslitteraturen består av en lärobok och en tillhörande övningsbok:

- Lundgren, Rönnqvist, Värbrand: *Optimeringslära*, Studentlitteratur, 2008 (ISBN: 9789144053141)
- Henningsson, Lundgren, Rönnqvist, Värbrand: *Optimeringslära: Övningsbok*, Studentlitteratur, 2010 (ISBN: 9789144067605)

KURSFORDRINGAR

Kursinnehållet definieras av litteraturhänvisningarna i föreläsningsplanen. Varje avsnitts vikt framgår av den undervisningstid som det ägnas. Kraven på problemlösningsförmåga gäller samtliga metoder som genomgått på föreläsningar och/eller lektioner. Uppgifterna på tentamen är vanligen något mer avancerade än de som genomgått i undervisningen. (Eftersom de senare ofta är enklare övningar som ska underlätta inlärningen, medan tentamensuppgifterna utvärderar vilka kunskaper som har uppnåtts).

EXAMINATION

Tentamen: Tentamen är skriftlig och består av sex uppgifter om vardera tre till fyra poäng. Som mest kan 21 poäng erhållas och för godkänt krävs minst 8 poäng. På tentamen får medtagas **ett** A4-blad med **dubbelsidiga handskrivna** anteckningar. Observera att kopierade blad inte tillåts. Kurslitteratur får **ej** medtagas på tentamen. Miniräknare är **inte** tillåten. Tidigare tentamina återfinns på kursplatsen LISAM. Förstagångstentamen ges **onsdag 2016-10-26 kl 08-13**.

Laborationer: I kursen ingår fyra obligatoriska laborationsmoment, tre salslaborationer samt en projektuppgift. Samtliga av dessa moment ska genomföras i en grupp om högst två personer.

Det är tillåtet att diskutera laborationsuppgifterna mellan tvåpersonsgrupperna, men det är naturligtvis inte tillåtet att samarbeta mellan grupperna eller att plagiera lösningar. Vid behov kan rättningen av en uppgift komma att kompletteras med en muntlig redovisning.

I laborationsinformationen som delas ut på lektionstid, och som finns upplagd på kursplatsen LISAM, finns ytterligare instruktioner samt datum för redovisning.

KURSANSVARIG OCH EXAMINATOR

Nils-Hassan Quttineh, tel: 28 21 85, e-post: nils-hassan.quttineh@liu.se

HEMSIDA

Kursens hemsida är <http://courses.mai.liu.se/GU/TAOP14/>
Information till deltagare på kursen läggs fortlöpande ut på kursplatsen LISAM.

LÄRARE**Föreläsare**

Nils-Hassan Quttineh e-post: nils-hassan.quttineh@liu.se tel: 28 21 85

Gruppledare

Klass	Namn	Tel	E-post
I2a	Emmy Sjöholm	-	emmsj179@student.liu.se
I2b, I2f	Oleg Burdakov	28 14 73	oleg.burdakov@liu.se
I2c, I2d	Olle Hynén Ulfsjö	-	ollul666@student.liu.se
I2e	Joel Kvik	-	joekv051@student.liu.se
Ii2a, Ii2b	Nils-Hassan Quttineh	28 21 85	nils-hassan.quttineh@liu.se

FÖRELÄSNINGSPLAN

Linjärprogrammering		Kurslitteratur
Fö 1	Kurspresentation; grundläggande begrepp och introduktion till optimeringslära	1, 2.1–2.3
Fö 2	Formulering av LP-problem; modelleringsspråket AMPL	3 20.1–20.5
Fö 3	Linjärprogrammering: Extrempunkter, baslösningar och simplexmetoden	4.1–4.5
Fö 4	Simplexmetoden, fas I och II	4.6–4.10
Fö 5	Dualitet; relaxationer och restriktioner; känslighetsanalys	6, 5.1–5.3
Fö 6	Känslighetsanalys; introduktion till ickelinjär programmering	5.4–5.5 9.1, 2.4–2.6
Ickelinjär programmering		
Fö 7	Konvexitetsteori Sökmeter för obegränsad optimering	9.2–9.3 10
Fö 8	Optimalitetsvillkor: KKT-villkoren	11
Fö 9	Frank–Wolfe metoden Lagrangedualitet och Lagrangerelaxation	12.1 17.1–17.2
Fö 10	Lagrangedualitet och Lagrangerelaxation	17.1–17.2

LEKTIONSPLAN

I lektionsplanen föreslås uppgifter som är lämpliga att arbeta med i den angivna ordningen. I övningsboken finns ytterligare uppgifter som hör till respektive avsnitt.

Vissa lektioner kommer extra uppgifter (E) att delas ut. Kursiverade uppgifter kommer läraren troligtvis att gå igenom på tavlan. För att visa hur typiska tentafrågor ser ut, med anknytning till respektive lektion, hänvisas också till kompendiet *Typiska Tentamensuppgifter i TAOP14* som ni hittar på LISAM.

Linjärprogrammering	Uppgifter
Le 1. Grafisk lösning och konvexitet	<i>2.2a-c</i> , E, 2.6, 2.4a-c, 2.3
Le 2. Formulering av LP-problem	E, 3.4, 3.3, 3.1, 3.6, 3.2, 3.5, 3.8 Tenta: 1, 3
Le 3. Simplexmetoden: baslösningar	E, 4.1, 4.2, 4.3, 4.5 Tenta: 4
Le 4. Simplexmetoden: fas I, fas II	E, 4.7, 4.8, 4.9, 4.11, 4.14 Tenta: 5, 6
Le 5. Dualitet	E, 6.6a, 6.1, 6.5, 6.2, 6.4, 6.7 Tenta: 7, 8
Le 6. Känslighetsanalys, algebraiskt	<i>5.4</i> , 5.5, 5.1, 5.6, 5.9 Tenta: 10, 11
Le 7. Känslighetsanalys, datautskrift	<i>5.8</i> , 5.7, 5.12, 5.11 Tenta: 13, 14

Ickelinjär programmering	Uppgifter
Le 8. Konvexitetsteori	<i>9.6a</i> , 2.5, 9.9, 9.7, 9.8, 9.4 Tenta: 15, 16, 17
Le 9. Obegränsad optimering	<i>10.5</i> , E, 9.10, 9.11, 10.1b Tenta: 19, 20, 22
Le 10. KKT-villkoren	<i>11.4</i> , 11.1, 11.3, 11.8, 11.5 Tenta: 23, 25
Le 11. Franke–Wolfe metoden	<i>12.6</i> , 12.1, 12.4, 12.8 Tenta: 26, 29
Le 12. Lagrangedualitet, Lagrangerelaxation	<i>17.3a</i> , 17.4, 17.5, 17.10, 17.9, 17.6a Tenta: 30, 31, 32