

1er. cuat. 1988

UNIVERSIDAD DE BUENOS AIRES

FACULTAD DE CIENCIAS EXACTAS Y NATURALES

C-88
27

DEPARTAMENTO: ..Computación.....

ASIGNATURA: ..**OPTIMIZACION**.....

CARRERA/S: ..Comp. Cient.-Lic. en Cs. de la Computación (Optativa).-
Lic. en Matemática (or. Aplicada) (Obligatoria).

.....PLAN.....

CARACTER: Optativa (4ptos.).... (indicar si es obligatoria u. optativa)
Obl. 03 A (pl. Nuevo) - Opt 03 A (pl. Viejo)

DURACION DE LA MATERIA: ..Cuatrimestral... (indicar si es cuat. o anual)

HORA DE CLASE: a) TEORICAS...4...Hs. b) Problemas...6...Hs.

c) Laboratorio...Hs. d) Seminarios...Hs. e) Totales 10.

ASIGNATURAS CORRELATIVAS: ..Cálculo Numérico II (TP) e Investigación...
Operativa para Comp. Cient. y Lic. en Comp.

Investigación Operativa, Análisis Complejo
y Elementos de Cálculo Numérico para Lic. en Mat Aplicada (plan 1982)
Ecuaciones Diferenciales para Lic en Mat..
Aplicada (plan anterior a 1982).

PROGRAMA:

1. El problema general de programación no lineal. Ejemplos de aplicaciones a la Economía, Ingeniería Naval, Civil, Eléctrica, problemas de localización, modelos dinámicos que utilizan teoría de control discreta, etc.
2. Condiciones necesarias para mínimos locales. Direcciones factibles. condiciones suficientes para mínimos relativos. Funciones convexas y cóncavas. Convergencia global de los algoritmos de descenso. Multifunciones cerradas. Teorema de convergencia global. Orden de convergencia.
3. Métodos de minimización unidimensional. Fibonacci, Secciones aureas, algoritmo de n puntos, interpolaciones (Newton, regla falsi) splines. Algoritmos cerrados. El método del gradiente. Convergencia global. El caso cuadrático (zigzag). Desigualdad de Kantorovich. Convergencia en el caso cuadrático.
4. Matrices pseudoinversas y el problema lineal de mínimos cuadrados. Soluciones básicas y de mínima norma. Algoritmos. Descomposición en valores singulares. Número de condición. Acotación de errores. Método de Newton, convergencia cuadrática. El caso de rango deficiente. direcciones de curvatura negativa. Método de Levenberg-Marquard. Algoritmo secante. Eficiencia computacional.
5. Método de direcciones conjugadas. Teorema de las direcciones conjugadas. Teorema de expansión de subespacios. Método de Fletcher-Reeves y Polak-Ribieré. Método quasi-Newton. Corrección de rango-1. Método Davidon-Fletcher-powell. La familia de Fletcher. Propiedades de convergencia. Scaling. Inestabilidad numérica. Factorizaciones de Gill y Murray. Teorema de Schuller y Dennis Moré. La fórmula de Broyden-Fletcher-Goldfarb y Shanno. El método de Davidon de 1975. Método sin derivadas. Problemas test. Software disponible.

aprobado por Resolución *CD 801/89*

6. Problema de mínimos cuadrados no lineales. Aplicaciones. Método de Gauss-Newton y Levenberg Marquardt. u!- de pseudoinversas. Problemas de convergencia. El caso Separable. Programas disponibles.

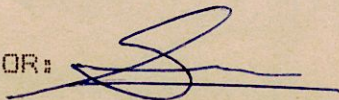
7. Problemas con restricciones. Puntos regulares. Condiciones necesarias y suficientes para restricciones de igualdad. Multiplicadores de Lagrange. Teorema de sensibilidad. Condiciones de Kuhn-Tucker. Condiciones de 2do. orden. Método de direcciones factibles. El método de gradiente proyectado y del gradiente reducido. Funciones de penalidad y barrera. Teoremas. Funciones de penalidad exacta. El método lagrangiano aumentado y programas disponibles.

BIBLIOGRAFIA(Indicar título del libro, Autor, Editorial y año de Pub)

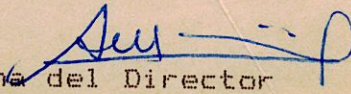
- David Luenberger, Introduction to linear and no linear programming Addison-Wesley 1973.
- P. Gill, W. Murray. Numerical methods for unconstrained optimization. Academic Press.
- P. Gill, W. Murray. Numerical methods for constraint optimization. Academic Press.
- G.R. Walsh. Methods of optimization. John Wiley y Sons, 1975.
- A. Ben Israel, Generalized Inverses, Theory and Applications. John Wiley, 1974.
- D. Pierre y M. Lowe. Mathematical Programming via Augmented Lagranges. Addison-Wesley, 1975.
- Robert B. Schnabel. Analyzing and improving quasi-Newton methods for unconstrained optimization. Department of Computer Science. Cornell University, ITHACA, New York.
- Friedlander, Martinez, Scolnik: Generalized inverses and a new stable secant type minimization algorithm, Proceedings of the 8 th IFIP Conference on Optimization Techniques, Springer-Verlag, 1978.
- L.C.W. Dixon: Quasi-Newton algorithms generate identical points. Mathematica Programming 2 (1972) 383-387.
- Fridrich Sloboda: A generalized conjugate gradient algorithm for minimization. Numerische Mathematik 35, 223-230 (1980).
- Dennis y Moré: A characterization of superlinear convergence and its applications to Quasi-Newton Methods. Mathematics of Computation, Volume 28, Number 126, April 1974, p 549-560.
- Jorge J. Moré y Danny C. Sorensen: On the use of directions of negative curvature in modified Newton Method. Mathematical Programming 16 (1979) 1-20.
- Programa GSR CH (Minpack Project-Aragonne National Laboratories-1979).
- Subrutina PLYLS (Algoritmo de Scolnik de minimización unidimensional-1979).
- M.J.F. Powell: A method for minimizing a sum of squares of non-linear functions without calculating derivatives. The computer Journal. 1965, 303-307.
- P.E. Gill and W. Murray: Quasi-Newton Methods for unconstrained optimization. J. Inst. Maths. Applics (1972) 9, 91-108.
- J.J. Moré: The Levenberg-Marquardt algorithm: Implementation and theory. Proceedings of the 1977 DUNDEE Conference on Numerical Analysis, Springer Verlag.
- M.J.D. Powel: Constrained optimization by a variable metric method. Cambridge University. (programa).
- Andrew R. Conn and Tomasz Pietrzykowski: A penalty function method converging directly to a constrained optimum. Siam Journal on numerical analysis. Vol.14, N- 2, April 1977.

Fecha.....22/11/88.....

FIRMA DEL PROFESOR:



Firma del Director



ACLARACION DE FIRMA: HUGO SCOLNIK

Aclaracion de Firma Lic. Gioia