



FSF3822 Tillämpad icke linjär optimering 7,5 hp

Applied Nonlinear Optimization

När kurs inte längre ges har student möjlighet att examineras under ytterligare två läsår.

Fastställande

Kursplan för FSF3822 gäller från och med VT19

Betygsskala

P, F

Utbildningsnivå

Forskarnivå

Särskild behörighet

Civilingenjörs- eller Masterexamen med minst 30 hp inom matematik (en- och flervariabelanalys, linjär algebra, differentialekvationer och transformer), minst 6 hp inom matematisk statistik, 6hp inom numerisk analys och 6 hp inom optimeringslära.

Undervisningsspråk

Undervisningsspråk anges i kurstillfällesinformationen i kurs- och programkatalogen.

Lärandemål

Kursens övergripande mål är dels att studenten ska behärska modeller, metoder och teori för olika varianter av icke linjär optimering, dels att studenten ska kunna modellera och

ma befintlig programvara lösa realistiska icke-linjära optimeringsproblem, samt presentera resultaten muntligt och skriftligt.

Efter genomgången kurs ska studenten kunna:

- Förklara hur steepest-descentmetoden, konjugerade gradientmetoden och kvasi-Newton-metoder fungerar för att minimera en strikt konvex kvadratisk funktion.
- Förklara hur active-set-metoder för konvexa kvadratiske programmeringsproblem fungerar.
- Förklara hur sekvensiella kvadratiske programmeringsmetoder fungerar.
- Förklara hur primal-duala inre punktmetoder för kvadratiske och icke-linjära programmeringsproblem fungerar.
- Utgående från en tillrättalagd problembeskrivning formulera ett icke-linjärt programmeringsproblem och lösa det med hjälp av det modelleringspråk som används i kursen.
- Tolka svaren i de lösta tillrättalagda verkliga problem med hjälp av fundamentala begrepp som känslighetsanalys.
- Under lämpliga förutsättningar kunna härleda optimalitetsvillkor för icke-linjära optimeringsproblem.
- Använda lämpliga optimalitetsvillkor för att avgöra om en given punkt är en lokal, eller till och med global, minpunkt till ett givet icke-linjärt programmeringsproblem.
- Kunna redogöra för om erhållen lösning till det tillrättalagda problemet är en lokal eller global minpunkt beroende på egenskaper hos problemfunktionerna.
- Beskriva vad relaxeringar är.
- Relatera modelleringen till det egna forskningsområdet.

Studenter som tillgodogjort sig kursen väl ska dessutom kunna:

- I tillämpliga fall kunna avgöra kvalitet hos lösningar till problem genom att relatera till konvexa relaxerade problem.
- Redogöra för hur kvasi-Newtonmetoder för icke-linjära programmeringsproblem fungerar.
- Ge exempel på hur sekvensiella kvadratiske programmeringsmetoder och inre punktmetoder kan modifieras för ickekonvexa problem samt ange grundläggande egenskaper hos meritfunktioner i sådana metoder.

Kursinnehåll

Teori och metoder:

Icke-linjär optimering utan bivillkor: optimalitetsvillkor, Newtonmetoder, kvasi-Newton-metoder, konjugerade gradientmetoder, icke-linjära minsta-kvadratproblem. Icke-linjär optimering med bivillkor: optimalitetsvillkor, kvadratisk programmering, sekvensiell kvadratisk programmering, barriärmetoder, primal-duala inre punktmetoder. Semidefinit programmering med inre punktmetoder. Konvexitet och konvexa relaxeringar.

Projektuppgifter:

Denna del av kursen är uppbyggd kring praktisk optimeringsmodellering och problemlösning. Här ska man formulera optimeringsproblem, tillämpa sina metodkunskaper och

lösa problemen med befintlig optimeringsprogramvara. Detta genomförs i form av projekt i mindre grupper. Ett viktigt inslag är samarbete inom gruppen samt muntlig och skriftlig presentation av resultaten.

Kursupplägg

Lektioner och projektarbeten

Kurslitteratur

Linear and Nonlinear Programming av S.G.Nash och A.Sofer, McGraw-Hill, samt kompletterande material från institutionen.

Examination

- PRO1 - Projektarbete, 3,0 hp, betygsskala: P, F
- TEN1 - Skriftlig tentamen, 4,5 hp, betygsskala: P, F

Examinator beslutar, baserat på rekommendation från KTH:s handläggare av stöd till studenter med funktionsnedsättning, om eventuell anpassad examination för studenter med dokumenterad, varaktig funktionsnedsättning.

Examinator får medge annan examinationsform vid omexamination av enstaka studenter.

Övriga krav för slutbetyg

Projektuppgifter

Skriftlig tentamen

Etiskt förhållningssätt

- Vid grupparbete har alla i gruppen ansvar för gruppens arbete.
- Vid examination ska varje student ärligt redovisa hjälp som erhållits och källor som använts.
- Vid muntlig examination ska varje student kunna redogöra för hela uppgiften och hela lösningen.