

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего профессионального образования
«Владимирский государственный университет
имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых»
(ВлГУ)



УТВЕРЖДАЮ
 Проректор по УМР

А.А.Панфилов

« 17 » 04 2015 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
Методы оптимизации и исследование операций
 (наименование дисциплины)

Направление подготовки: 02.03.03 Математическое обеспечение и администрирование информационных систем

Профиль/программа подготовки

Уровень высшего образования: бакалавриат

Форма обучения: очная, ускоренная

Семестр	Трудоемкость ед./ час.	зач.	Лекции, час.	Практич. занятия, час.	Лаборат. работы, час.	СРС, час.	Форма промежу- точного кон- троля (экз./зачет)
1	2/72		-	-	-	72	Переаттестация Зачет
5	4/144		36	-	18	54	Экзамен 36
Итого	6/216		36	-	18	126	Переаттестация зачет, Экзамен

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения дисциплины (модуля) «Методы оптимизации и исследование операций» являются ознакомление студентов, обучающихся по направлению «Математическое обеспечение и администрирование информационных систем», с методами, накопленными в этой теории. Последнее означает, что студенты по окончании курса должны владеть навыками по решению прикладных экстремальных задач.

Одной из характерных особенностей современной эпохи является все возрастающее внимание к проблемам управления. Как никогда прежде, ощущается потребность в плодотворном и эффективном использовании природных богатств, людских ресурсов, материальных и технических средств. На математическом языке такие задачи могут быть сформулированы как задачи отыскания экстремума некоторой функции или функционала. В результате работ многих математиков по их решению стало возможным говорить о теории экстремальных задач.

Задачи дисциплины:

- изучение основных приемов и методов решения оптимизационных задач;
- формирование навыков построения оптимизационных моделей, наиболее полно отвечающих требованиям поставленной задачи;
- изучение способов реализации методов оптимизации в виде программ для ЭВМ;
- приобретение навыков планирования экспериментов и обработки их результатов.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Данная дисциплина относится к базовой части ОПОП. Изучение дисциплины является продолжением с уровня СПО и проходит в 5-м семестре, с частичной переаттестацией в 1-м семестре. Дисциплина базируется на знаниях, приобретённых студентами в рамках курсов математического анализа, геометрии и топологии, дифференциальных уравнений, дискретной математики и др.

Данный курс обеспечивает дальнейшее изучение дисциплин «Моделирование информационных систем и технологий», «Распределённая обработка информации» и является базовым для изучения специальных дисциплин.

Знания, полученные в рамках изучения данной дисциплины, могут быть применены для написания выпускной квалификационной работы.

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

В результате освоения дисциплины обучающийся должен овладеть следующими компетенциями:

- способность применять в профессиональной деятельности знания математических основ информатики (ОПК-2);
- готовность к разработке моделирующих алгоритмов и реализации их на базе языков и пакетов прикладных программ моделирования (ПК-3).

В результате освоения дисциплины студент должен демонстрировать освоение указанных компетенций по дескрипторам «знания, умения, владения», в соответствии с тематическими модулями дисциплины, применять полученные знания в последующем обучении и профессиональной деятельности:

- 1) Знать: определение общих форм, закономерностей, инструментальных средств для данной дисциплины; корректные постановки классических задач;
- 2) Уметь: понять поставленную задачу; формулировать результат; на основе анализа увидеть и корректно сформулировать математически точный результат;
- 3) Владеть: способностью учиться; фундаментальной подготовкой по основам профессиональных знаний; пониманием корректности постановок задач; способностью передавать результат проведенных физико-математических и прикладных исследований в виде конкретных рекомендаций, выраженных в терминах предметной области изучавшегося явления.

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Общая трудоемкость дисциплины составляет 6 зачетных единиц, 216 часов.

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)						Объем учебной работы, с применением интерактивных методов (в часах / %)	Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра), форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	Контрольные работы	СРС	КП / КР		
1	Переаттестация. Понятие исследования операций. Задача линейного программирования. Симплекс метод.	1	1-10	-	-	-	-	72		-	Переаттестация зачет
	Всего (семестр 1)							72			Переаттестация зачет
2	Введение в дисциплину. Постановка задачи оптимизации.	5	1	2	-	-	-	14	-	1 (50%)	
3	Методы минимизации функций одной переменной.	5	2-7	12	-	8	-	20	-	10 (50%)	Рейтинг-контроль 1
4	Методы минимизации функций многих переменных. Элементы выпуклого анализа. Эвристические методы.	5	8-18	22	-	10	-	20	-	12 (37%)	Рейтинг-контроль 2,3
Всего (5 семестр)				36	-	18	-	54		23 (42%)	Экзамен 36
Итого				36		18		126		23 (42%)	Переаттестация зачет, Экзамен

СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

ЛЕКЦИИ

Лекция 1. Введение. Постановка задачи оптимизации. Классификация задач математического программирования (2 часа).

Лекция 2. Методы минимизации функций одной переменной. Классический метод. Методы дихотомии, золотого сечения (4 часа).

Лекция 3. Методы минимизации функций одной переменной. Метод ломаных (4 часа).

Лекция 4. Методы минимизации функций одной переменной. Выпуклые функции. Метод касательных (4 часа).

Лекция 5. Методы минимизации функций многих переменных. Постановка задачи. Задача на безусловный экстремум. Классический метод (4 часа).

Лекция 6. Методы минимизации функций многих переменных. Метод множителей Лагранжа (4 часа).

Лекция 7. Задачи выпуклого программирования. Седловая точка. Теоремы Куна-Таккера (4 часа).

Лекция 8. Численные методы минимизации функций многих переменных. Метод случайного поиска. Градиентные методы. Метод Ньютона (4 часов).

Лекция 9. Численные методы минимизации функций многих переменных. Метод покоординатного спуска. Метод множителей Лагранжа. Метод штрафных функций (4 часа).

Лекция 10. Эвристические методы. Генетические алгоритмы. Муравьиный алгоритм (2 часа).

ЛАБОРАТОРНЫЕ ЗАНЯТИЯ

Лабораторная работа №1. Методы минимизации функций одной переменной. Метод дихотомии, метод золотого сечения (4 часа).

Лабораторная работа №3. Методы минимизации функций одной переменной. Метод ломаных (2 часа).

Лабораторная работа №3. Методы минимизации функций одной переменной. Метод касательных (2 часа).

Лабораторная работа №4. Методы минимизации функций многих переменных. Градиентные методы (4 часа).

Лабораторная работа №5. Численные методы минимизации функций многих переменных. Метод покоординатного спуска (2 часа).

Лабораторная работа №6. Численные методы минимизации функций многих переменных. Метод штрафных функций (4 часа).

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Для достижения планируемых результатов освоения дисциплины используются следующие образовательные технологии:

- информационно-развивающие технологии;
- развивающие проблемно-ориентированные технологии;
- личностно ориентированные технологии обучения.

Методы	Лекция	Лабораторные занятия	СРС
Метод IT	+	+	+
Работа в команде		+	
Case-study		+	
Проблемное обучение	+	+	
Контекстное обучение		+	+
Обучение на основе	+	+	+

опыта			
Индивидуальное обучение		+	+
Междисциплинарное обучение	+	+	+
Опережающая самостоятельная работа			+

В рамках изучения дисциплины возможно применение широко спектра образовательных технологий: лекционно-семинарская система обучения (традиционные лекционные и лабораторные занятия); case-study; метод проектов; обучение в малых группах; мастер-классы; применение мультимедиа технологий (проведение лекционных занятий с применением компьютерных презентаций и демонстрационных роликов с помощью проектора или ЭВМ); технология развития критического мышления; информационно-коммуникационные технологии (применение информационных технологий для мониторинга текущей успеваемости студентов и контроля знаний).

6. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ИТОГАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

Семестр 1:

а) Вопросы к зачету по переаттестации

1. Что называется операцией?
2. Что составляет предмет исследования операций?
3. Назовите основные этапы операционного исследования и дайте их краткую характеристику.
4. Классификация экономико-математических моделей.
5. Сформулируйте основные принципы моделирования.
6. Сформулируйте основную задачу математического программирования.
7. Сформулируйте основную задачу выпуклого программирования.
8. Определение возможного направления.
9. Дайте определение седловой точки.
10. Сформулируйте достаточное условие оптимальности.
11. Теорема куна-таккера.
12. Сформулируйте основную задачу линейного программирования в канонической форме.
13. Докажите эквивалентность различных форм записи ЗЛП.
14. Что такое опорные решения?
15. Как определяется базис опорного плана?
16. В чем состоит идея симплекс-метода?
17. Как осуществляется выбор переменной для вывода из базиса?
18. Как осуществляется выбор переменной для ввода в базис?
19. Сходимость симплекс-процедуры.
20. Признаки неразрешимости задачи линейного программирования.
21. В каких случаях применяется метод искусственного базиса?
22. Какой базисный план называется вырожденным?
23. Объясните экономический смысл двойственной задачи.

24. Какие существуют методы построения начального опорного плана транспортной задачи?

25. Сформулируйте задачу целочисленного линейного программирования.

26. Как принимается решение об окончании поиска при реализации поисковых методов?

27. Сформулируйте условия сходимости градиентных и квазиньютоновских методов.

28. Какие методы одномерного поиска применяются в алгоритмах минимизации выпуклых и невыпуклых функций?

б) Вопросы для проверки самостоятельной работы

1. Что называется операцией?

2. Что составляет предмет исследования операций?

3. Назовите основные этапы операционного исследования и дайте их краткую характеристику.

4. Классификация экономико-математических моделей.

5. Сформулируйте основные принципы моделирования.

6. Сформулируйте основную задачу математического программирования.

7. Сформулируйте основную задачу выпуклого программирования.

8. Определение возможного направления.

9. Дайте определение седловой точки.

10. Сформулируйте достаточное условие оптимальности.

11. Теорема куна-таккера.

12. Сформулируйте основную задачу линейного программирования в канонической форме.

13. Докажите эквивалентность различных форм записи ЗЛП.

14. Что такое опорные решения?

15. Как определяется базис опорного плана?

16. В чем состоит идея симплекс-метода?

17. Как осуществляется выбор переменной для вывода из базиса?

18. Как осуществляется выбор переменной для ввода в базис?

19. Сходимость симплекс-процедуры.

20. Признаки неразрешимости задачи линейного программирования.

21. В каких случаях применяется метод искусственного базиса?

22. Какой базисный план называется вырожденным?

23. Объясните экономический смысл двойственной задачи.

24. Какие существуют методы построения начального опорного плана транспортной задачи?

25. Сформулируйте задачу целочисленного линейного программирования.

26. Как принимается решение об окончании поиска при реализации поисковых методов?

27. Сформулируйте условия сходимости градиентных и квазиньютоновских методов.

28. Какие методы одномерного поиска применяются в алгоритмах минимизации выпуклых и невыпуклых функций?

Семестр 5:

Контрольные вопросы к рейтинг-контролю №1

1. Построить минимизирующую последовательность для функции $J(u) = \arctg(u)$.

2. Найти множество U^* всех точек минимума для функции $J(u)$:

$$J(u) = \begin{cases} |u^2 - 1|, & u \neq 1, \\ 1, & u = 1. \end{cases}$$

3. Пусть функция $J(u) = ||u^2 - 1| - 1|$. Найти все локальные минимумы данной функции и ответить на вопрос: на каких отрезках она является унимодальной.

4. Решить: $J(u) = \sin^3(u) + \cos^3(u) \rightarrow \text{extr. } u \in [0; 2\pi]$.

5. Решить: $J(u) = \begin{cases} \left(1 + e^{\frac{1}{u}}\right)^{-1}, & u \neq 0; \\ 0, & u = 0. \end{cases} \rightarrow \text{extr}, u \in R.$
6. Привести пример функций, удовлетворяющих условию Липшица, но не являющихся унимодальной (не менее трех функций). Ответить на вопрос: удовлетворяет ли условиям Липшица функция унимодальная на отрезке. Утверждение доказать.
7. Рассмотреть первые шесть шагов метода ломаных для функции $J(u) = ||u^2 - I| - I|$ на отрезке $[-2; 2]$ при $\forall u_0 \in [-2; 2]$.
8. Найти область выпуклости функции $J(u) = \sin(u) + \sin(2u)$.
9. Решить: $J(u) = (x + y + 1)^{-(x^2 - xy + y^2)} \rightarrow \text{extr}, u = (x, y) \in E^2$.
10. Решить: $J(u) = xy^2z^3(1 - x - 2y - 3z) \rightarrow \text{extr}, u = (x, y, z) \in E^3$.
11. Решить: $J(u) = x \rightarrow \min, u \in U, U = \left\{ u = (x, y) \in E^2 : y - x^{\frac{3}{2}} = 0, x \geq 0 \right\}$.
12. Решить: $J(u) = x \rightarrow \text{extr}, u \in U, U = \{ u = (x, y) \in E^2 : x^p + y^q = 0 \}$, где p и q натуральные числа.
13. При каких a, b и c функция $J(u) = ax^2 + 2bxy + cy^2$, будет выпукла, вогнута? $u = (x, y) \in E^2$.
14. Найти области выпуклости функций: $J(u) = \sin(x + y + z), J(u) = \sin(x^2 + y^2 + z^2), u = (x, y, z) \in E^3$.
15. Привести пример корректно сформулированной прикладной задачи оптимизации, с наличием не менее двух ограничений. Указать к какому классу и типу относится сформулированная задача.
16. Найти множество U^* – всех точек минимума функции $J(u) = \sin \left[\pi \exp(-u^2) \right]$, на универсальном множестве $U = R^1$. Построить минимизирующие последовательности для $J(u)$, которая сходится к множеству U^* и не сходится.
17. Найти множество U^* – всех точек минимума функции $J(u) = 1 - \cos \left[\pi \exp(-u^2 - \ln \frac{1}{2}) \right]$, на универсальном множестве $U = R^1$. Построить минимизирующие последовательности для $J(u)$, которая сходится к множеству U^* и не сходится.
18. Вывести формулу для вычисления положения точек золотого сечения отрезка $[a, b]$.
19. Выяснить на каких отрезках функция $J(u)$ является унимодальной:
 $J(u) = au^2 + bu + c, J(u) = \sqrt{|u|}, J(u) = e^u, J(u) = \cos(u), J(u) = \text{sh}(u).$
20. Выяснить на каких отрезках функция $J(u)$ является унимодальной:
 $J(u) = au^2 + bu + c, J(u) = \sqrt{|u|}, J(u) = e^{-u}, J(u) = \sin(u), J(u) = \text{ch}(u).$
21. Оценить постоянную Липшица L для функции $J(u) = -u^3 + 2u^2 + 5u - 2$ на отрезке $[-2, 3]$.
22. Оценить постоянную Липшица L для функции $J(u) = -2u^3 + 6u^2 - u + 10$ на отрезке $[-2, 3]$.

23. Найти глобальный минимум функции J^* по методу последовательного перебора для функции $J(u)$ $J(u) = -u^3 + 2u^2 + 5u - 2$ на отрезке $[-2, 3]$.
24. Найти глобальный минимум функции J^* по методу последовательного перебора для функции $J(u) = -2u^3 + 6u^2 - u + 10$ на отрезке $[-2, 3]$.
25. Найти точку максимума функции ($f(x) \rightarrow \max$) $f(x) = 2x_1 + 4x_2 - x_1^2 - 2x_2^2$ при ограничениях $\begin{cases} x_1 + 2x_2 \leq 8 \\ 2x_1 - x_2 \leq 12 \end{cases}$.
26. Найти точку максимума функции ($f(x) \rightarrow \max$) $f(x) = x_1 + 4x_2 + x_1x_2 - 2x_1^2 - 2x_2^2$ при ограничениях $\begin{cases} x_1 + 2x_2 \leq 12 \\ 3x_1 + x_2 \leq 15 \end{cases}$.
27. Найти точку максимума функции ($f(x) \rightarrow \max$) $f(x) = -x_1^2 - x_2^2 + x_1 + 8x_2$ при ограничениях $\begin{cases} x_1 + x_2 \leq 7 \\ x_2 \leq 5 \end{cases}$.
28. Найти точку максимума функции ($f(x) \rightarrow \max$) $f(x) = -2x_1 + 8x_2 - x_1^2 - x_2^2$ при ограничениях $\begin{cases} x_1 + 2x_2 \leq 12 \\ -x_1 + x_2 \geq 8 \end{cases}$.
29. Найти точку максимума функции ($f(x) \rightarrow \max$) $f(x) = (x_1 - 3)^2 + (x_2 - 4)^2$ при ограничениях $\begin{cases} 3x_1 + 2x_2 \geq 7 \\ 10x_1 - x_2 \leq 8 \end{cases}$.

Контрольные вопросы к рейтинг-контролю №2

1. Найти все точки локального безусловного минимума у следующих функций.

1. $f(x_1, x_2) = (x_1 + x_2 - 1)^2 + x_1 - 2x_2$;
2. $f(x_1, x_2) = (x_1 - x_2 + 1)^2 + (x_1 + x_2 - 1)^2$;
3. $f(x_1, x_2) = (x_1^2 + x_2 + 2)^2 - x_1^2$;
4. $f(x_1, x_2) = (x_1 - 2x_2^2 + 1)^2 + x_1$;
5. $f(x_1, x_2) = (x_1^2 + x_2^2 + 1)^2 + x_1^2 - x_2^2$;
6. $f(x_1, x_2) = (x_1^2 - x_2^2 + 4)^2 + x_1^2$;
7. $f(x_1, x_2) = (x_1^2 + 2x_2 + 1)^2 - 4x_2^2$;
8. $f(x_1, x_2) = (x_1 + x_2 + 3)^2 - x_1 + 2x_2$;
9. $f(x_1, x_2, x_3) = (x_1 + 2x_2 - x_3)^2 + (x_1 + x_2)^2 + (x_3 - 5)^2$;
10. $f(x_1, x_2, x_3) = (x_1 - 2x_2)^2 + (x_2 - 2x_3)^2 + (x_3 - 4)^2$;
11. $f(x_1, x_2, x_3) = (x_1 - 2x_2)^2 + (x_2 - 2x_3)^2 + (x_3 - 2x_1)^2 + (x_1 - 1)^2$;
12. $f(x_1, x_2, x_3) = (x_1 + 2x_2 + 4x_3)^2 + (x_1 - x_2 + 1)^2 + (x_2 + x_3 - 1)^2$;
13. $f(x_1, x_2) = x_1^3 + 2x_1^2 + x_1x_2 + 2x_1 - x_2^2$;
14. $f(x_1, x_2) = 2x_1^3 - x_1^2 + 3x_1x_2 - x_1 + 4x_2^2$;
15. $f(x_1, x_2) = x_1^3 + 5x_1^2 - 8x_1x_2 - x_1 + 4x_2^2$;
16. $f(x_1, x_2) = 10x_1^2 - x_1^3 + x_1x_2 + x_2^2$;

17. $f(x_1, x_2) = x_1^3 + x_1^2 - x_1 x_2 + x_1 + x_2^2$;
18. $f(x_1, x_2) = x_1(5/3 x_1^2 - x_1 - 1) + x_2(2x_1 + x_2)$;
19. $f(x_1, x_2) = x_1(-x_1^2 + x_1 + 4) + x_2(2x_1 + x_2)$;
20. $f(x_1, x_2) = 5x_1(x_1^2 + x_1 - 1) + 3x_2(x_1 + x_2)$;
21. $f(x_1, x_2) = 2x_1(x_1^2 + 2x_1 - 3/2) + 2x_2(-x_1 + x_2)$;
22. $f(x_1, x_2) = x_1(-x_1^2 + 5x_2) + 4x_2(x_1 + 2x_2)$;
23. $f(x_1, x_2) = 2x_1(2x_1^2 + x_1 - 1) + 2x_2(x_1 - x_2)$;
24. $f(x_1, x_2) = x_1(1 - x_1^2 + 6x_1) - x_2(x_1 + x_2)$.

2. Решить следующие задачи на условный минимум.

1. $(x_1 + x_2 - 1)^2 + (2x_1 - x_2 + 1)^2 \rightarrow \min; x_1 - x_2 = 1$.
2. $(x_1 + 2x_2 - 1)^2 + (x_1 + x_2)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 = 1$.
3. $(x_1 + 3x_2 - 6)^2 + x_1 \rightarrow \min; x_1 - x_2 = 0$.
4. $(x_1 - x_2 + 1)^2 - x_2 \rightarrow \min; 2x_1 + x_2 = 2$.
5. $x_1 + x_2 \rightarrow \min; 2x_1^2 + x_2^2 = 4$.
6. $2x_1 + x_2 \rightarrow \min; 2x_1^2 + x_2^2 = 4$.
7. $x_1 \rightarrow \min; (x_1 + x_2)^2 + x_1^2 = 1$.
8. $x_1 - x_2 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2^2 = 1$.
9. $x_1^2 + x_2 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2^2 = 1$.
10. $x_1^2 + x_2^2 \rightarrow \min; 2x_1^2 + x_2^2 = 4$.
11. $x_1^2 + 2x_2^2 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2^2 = 4$.
12. $x_1^2 + 2x_2^2 \rightarrow \min; 2x_1^2 + x_2^2 = 4$.
13. $(x_1 - x_2 + x_3 - 1)^2 + x_2^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3 = 1$.
14. $(x_1 - 2x_2)^2 + (x_2 + x_3)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3 = 1$.
15. $(x_1 + x_2 + x_3 - 1)^2 + (x_1 - x_2)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 - x_3 = 1$.
16. $(x_1 - x_2)^2 + (x_1 + x_3)^2 \rightarrow \min; x_2 + x_3 = 4$.
17. $(x_1 - x_2 + x_3 + 1)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3 = 1, x_1 - x_2 - x_3 = 2$.
18. $(x_1 + x_3)^2 + (x_1 + x_2)^2 \rightarrow \min; x_1 + 2x_3 = 4, x_2 + 2x_3 = 6$.
19. $(x_1 + 2x_2 + 3x_3 + 4)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3 = 1, 3x_1 + 2x_2 + x_3 = 0$.
20. $x_1 + 2x_2 + 3x_3 \rightarrow \min; x_1^2 + 2x_2^2 + x_3^2 = 1$.
21. $x_1 - x_2 + x_3 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2^2 - x_3 = 1$.
22. $x_1 + x_2 + x_3 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2 + x_3 = 1$.
23. $x_1^2 + x_2 + x_3 \rightarrow \min; x_1^2 + 2x_2 + x_3 = 1$.
24. $x_1^2 + x_2^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3^2 = 1$.

3. Найти все точки локального условного минимума у следующих функций при наличии ограничения $x \geq 0$.

1. $f(x_1, x_2) = (x_1 + x_2 - 1)^2 + x_1 - 2x_2$;
2. $f(x_1, x_2) = (x_1 - x_2 + 1)^2 + (x_1 + x_2 - 1)^2$;
3. $f(x_1, x_2) = (x_1^2 + x_2 + 2)^2 - x_1^2$;
4. $f(x_1, x_2) = (x_1 - 2x_2^2 + 1)^2 + x_1$;
5. $f(x_1, x_2) = (x_1^2 + x_2^2 + 1)^2 + x_1^2 - x_2^2$;
6. $f(x_1, x_2) = (x_1^2 - x_2^2 + 4)^2 + x_1^2$;
7. $f(x_1, x_2) = (x_1^2 + 2x_2 + 1)^2 - 4x_2^2$;
8. $f(x_1, x_2) = (x_1 + x_2 + 3)^2 - x_1 + 2x_2$;
9. $f(x_1, x_2, x_3) = (x_1 + 2x_2 - x_3)^2 + (x_1 + x_2)^2 + (x_3 - 5)^2$;
10. $f(x_1, x_2, x_3) = (x_1 - 2x_2)^2 + (x_2 - 2x_3)^2 + (x_3 - 4)^2$;
11. $f(x_1, x_2, x_3) = (x_1 - 2x_2)^2 + (x_2 - 2x_3)^2 + (x_3 - 2x_1)^2 + (x_1 - 1)^2$;
12. $f(x_1, x_2, x_3) = (x_1 + 2x_2 + 4x_3)^2 + (x_1 - x_2 + 1)^2 + (x_2 + x_3 - 1)^2$;
13. $f(x_1, x_2) = x_1^3 + 2x_1^2 + x_1x_2 + 2x_1 - x_2^2$;
14. $f(x_1, x_2) = 2x_1^3 - x_1^2 + 3x_1x_2 - x_1 + 4x_2^2$;
15. $f(x_1, x_2) = x_1^3 + 5x_1^2 - 8x_1x_2 - x_1 + 4x_2^2$;
16. $f(x_1, x_2) = 10x_1^2 - x_1^3 + x_1x_2 + x_2^2$;
17. $f(x_1, x_2) = x_1^3 + x_1^2 - x_1x_2 + x_1 + x_2^2$;
18. $f(x_1, x_2) = x_1(5/3x_1^2 - x_1 - 1) + x_2(2x_1 + x_2)$;
19. $f(x_1, x_2) = x_1(-x_1^2 + x_1 + 4) + x_2(2x_1 + x_2)$;
20. $f(x_1, x_2) = 5x_1(x_1^2 + x_1 - 1) + 3x_2(x_1 + x_2)$;
21. $f(x_1, x_2) = 2x_1(x_1^2 + 2x_1 - 3/2) + 2x_2(-x_1 + x_2)$;
22. $f(x_1, x_2) = x_1(-x_1^2 + 5x_2) + 4x_2(x_1 + 2x_2)$;
23. $f(x_1, x_2) = 2x_1(2x_1^2 + x_1 - 1) + 2x_2(x_1 - x_2)$;
24. $f(x_1, x_2) = x_1(1 - x_1^2 + 6x_1) - x_2(x_1 + x_2)$.

4. Решить следующие задачи на условный минимум заменяя ограничение типа «=» на ограничение типа « $\leq$ ».

1. $(x_1 + x_2 - 1)^2 + (2x_1 - x_2 + 1)^2 \rightarrow \min; x_1 - x_2 = 1$.
2. $(x_1 + 2x_2 - 1)^2 + (x_1 + x_2)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 = 1$.
3. $(x_1 + 3x_2 - 6)^2 + x_1 \rightarrow \min; x_1 - x_2 = 0$.
4. $(x_1 - x_2 + 1)^2 - x_2 \rightarrow \min; 2x_1 + x_2 = 2$.
5. $x_1 + x_2 \rightarrow \min; 2x_1^2 + x_2^2 = 4$.
6. $2x_1 + x_2 \rightarrow \min; 2x_1^2 + x_2^2 = 4$.
7. $x_1 \rightarrow \min; (x_1 + x_2)^2 + x_1^2 = 1$.

8. $x_1 - x_2 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2^2 = 1.$
9. $x_1^2 + x_2 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2^2 = 1.$
10. $x_1^2 + x_2^2 \rightarrow \min; 2x_1^2 + x_2^2 = 4.$
11. $x_1^2 + 2x_2^2 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2^2 = 4$
12. $x_1^2 + 2x_2^2 \rightarrow \min; 2x_1^2 + x_2^2 = 4.$
13. $(x_1 - x_2 + x_3 - 1)^2 + x_2^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3 = 1.$
14. $(x_1 - 2x_2)^2 + (x_2 + x_3)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3 = 1.$
15. $(x_1 + x_2 + x_3 - 1)^2 + (x_1 - x_2)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 - x_3 = 1.$
16. $(x_1 - x_2)^2 + (x_1 + x_3)^2 \rightarrow \min; x_2 + x_3 = 4.$
17. $(x_1 - x_2 + x_3 + 1)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3 = 1, x_1 - x_2 - x_3 = 2.$
18. $(x_1 + x_3)^2 + (x_1 + x_2)^2 \rightarrow \min; x_1 + 2x_3 = 4, x_2 + 2x_3 = 6.$
19. $(x_1 + 2x_2 + 3x_3 + 4)^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3 = 1, 3x_1 + 2x_2 + x_3 = 0.$
20. $x_1 + 2x_2 + 3x_3 \rightarrow \min; x_1^2 + 2x_2^2 + x_3^2 = 1.$
21. $x_1 - x_2 + x_3 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2^2 - x_3 = 1.$
22. $x_1 + x_2 + x_3 \rightarrow \min; x_1^2 + x_2 + x_3 = 1.$
23. $x_1^2 + x_2 + x_3 \rightarrow \min; x_1^2 + 2x_2 + x_3 = 1.$
24. $x_1^2 + x_2^2 \rightarrow \min; x_1 + x_2 + x_3^2 = 1.$

Контрольные вопросы к рейтинг-контролю №3

Оценка по рейтинг-контролю №3 формируется по итогам выполнения и защит лабораторных работ при ответе на дополнительные вопросы. Темы лабораторных работ:

- Метод дихотомии.
- Метод золотого сечения.
- Метод ломаных.
- Метод касательных.
- Метод множителей Лагранжа.
- Градиентный метод наискорейшего спуска.
- Метод условного градиента.
- Метод покоординатного спуска.
- Метод штрафных функций.

Вопросы к экзамену

1. Математическая постановка задачи оптимизации. Классификация задач оптимизации.
2. Основные определения методов оптимизации. Постановка задачи оптимизации для функций одной переменной. Классический метод.
3. Минимизация функций одной переменной. Метод деления отрезка пополам (Дихотомии).
4. Минимизация функций одной переменной. Симметричные методы. Метод Фибоначчи.
5. Минимизация функций одной переменной. Симметричные методы. Метод золотого сечения.
6. Минимизация функций одной переменной. Липшевость функции. Оценка константы Липшица.

7. Минимизация функций одной переменной. Метод ломаных. Описание алгоритма. Численная реализация метода ломаных.
8. Минимизация функций одной переменной. Метод ломаных. Теорема о сходимости метода ломаных.
9. Минимизация функций одной переменной. Методы перебора. Методы пассивного и последовательного перебора.
10. Выпуклые функции одной переменной. Необходимое и достаточное условие выпуклости (критерий выпуклости).
11. Выпуклые функции одной переменной. Теоремы о непрерывности, гладкости и липшевости выпуклой функции.
12. Выпуклые функции одной переменной. Теорема о касательной. Следствие теоремы о касательной.
13. Выпуклые функции одной переменной. Теорема о минимуме выпуклой функции.
14. Выпуклые функции одной переменной. Свойства выпуклых функций. Необходимые и достаточные условия выпуклости.
15. Минимизация функций одной переменной. Метод касательных. Описание алгоритма. Теорема о сходимости метода касательных.
16. Постановка задачи оптимизации для функций многих переменных. Основные определения. Теоремы о существовании минимума функции многих переменных.
17. Классический метод решения задачи условной и безусловной оптимизации для функций многих переменных.
18. Метод множителей Лагранжа оптимизации функций многих переменных.
19. Выпуклые множества. Основные определения и свойства.
20. Выпуклые функции многих переменных. Теорема о минимуме выпуклой функции.
21. Выпуклые функции многих переменных. Критерий выпуклости.
22. Выпуклые функции многих переменных. Критерий оптимальности.
23. Выпуклые функции многих переменных. Свойства выпуклых функций многих переменных.
24. Проекция точки на множество.
25. Задача выпуклого программирования. Седловая точка функции Лагранжа. Необходимый и достаточный признак седловой точки.
26. Задача выпуклого программирования. Взаимосвязь её решения с седловой точкой.
27. Задача выпуклого программирования. Теоремы Куна-Таккера.
28. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Общая идея градиентных методов. Способы выбора шага метода.
29. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Градиентный метод наискорейшего спуска. Геометрический смысл.
30. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Метод проекций градиента. Геометрический смысл.
31. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Метод условного градиента. Геометрический смысл.
32. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Метод Ньютона.
33. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Метод покоординатного спуска. Теорема о сходимости метода покоординатного спуска.
34. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Метод множителей Лагранжа.

35. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Метод штрафных функций. Описание алгоритма.
36. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Сходимость метода штрафных функций.
37. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Методы случайного поиска.
38. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Эвристические методы. Генетические алгоритмы. Компоненты генетического алгоритма.
39. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Эвристические методы. Генетические алгоритмы. Операторы генетического алгоритма.
40. Численные методы оптимизации функций многих переменных. Эвристические методы. Генетические алгоритмы. Настройка параметров генетического алгоритма.

Вопросы для проверки самостоятельной работы

1. Дайте определение унимодальной функции.
2. Каким образом в методе дихотомии гарантируется попадание точки минимума u^* в отрезок $[a_k, b_k]$ при любом $k > 0$?
3. Чем отличается метод дихотомии от метода золотого сечения?
4. Почему в методе золотого сечения, начиная со второй итерации, необходимо вычислять только один раз значение функции $J(u)$ вместо двух в методе дихотомии?
5. Какой из рассмотренных в лабораторной работе методов сходится быстрее и почему?
6. Дайте определение липшицевой функции.
7. Геометрическая интерпретация липшицевости функции.
8. Будет ли ломанная линия, получаемая при помощи метода ломанных, пересекать график функции $J(u)$ и почему.
9. К чему может привести заниженная оценка константы Липшица и почему?
10. Дайте определение выпуклой функции.
11. Геометрическая интерпретация выпуклой функции.
12. Всякая ли «липшицева» функция является выпуклой, и наоборот, всякая ли выпуклая функция является «липшицевой» и почему?
13. Каким образом определяется точка u_{k+1} после построения ломанной $g_k(u)$ в методе касательных?
14. Дайте определение градиента функции.
15. В какую сторону направлен вектор градиента.
16. Чем отличается метод условного градиента от метода наискорейшего спуска? Для какого класса задач используется метод условного градиента?
17. Дайте определения выпуклого множества.
18. Докажите, что отрезок является выпуклым множеством.
19. Что такое вспомогательное приближение в методе условного градиента и для чего оно используется?
20. Почему $k+1$ приближение, получаемое по формуле метода условного градиента, не выходит за пределы выпуклого множества U ?
21. Опишите идею метода покоординатного спуска.
22. Геометрический смысл метода покоординатного спуска.
23. Приведите формулу перебора координатных направлений.
24. Что называют удачной итерацией?
25. В каких случаях выполняется дробление шага?
26. Каково условие сходимости метода?
27. Дайте характеристику метода покоординатного спуска в сравнении с градиентными методами.

28. Приведите преимущества и недостатки метода покоординатного спуска.
29. Опишите идею метода штрафных функций.
30. Дайте определение штрафной функции.
31. Приведите примеры штрафных функций?
32. Каким образом решается вспомогательная задача в методе штрафных функций, какой способ применен в данной работе?
33. Каково условие сходимости метода?
34. Дайте характеристику метода штрафных функций в сравнении с ранее рассмотренными методами.
35. Приведите преимущества и недостатки метода штрафных функций.

ОБЪЕМ СРС И РАСПРЕДЕЛЕНИЕ ПО ВИДАМ УЧЕБНЫХ РАБОТ В ЧАСАХ

Вид СРС	Количество часов
Переаттестация	72
Работа с лекционным материалом, самостоятельное изучение отдельных тем дисциплины; поиск и обзор литературы и электронных источников; чтение и изучение учебника и учебных пособий.	20
Подготовка к проверочным работам	14
Выполнение домашних заданий, подготовка к лабораторным занятиям	20
Итого	126

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

а) основная литература:

1. Методы оптимизации и теории управления: методические указания к самостоятельной работе по дисциплинам «Методы оптимизации», «Математические методы теории управления» – Электрон. текстовые данные.– Липецк: Липецкий государственный технический университет, ЭБС АСВ, 2013.– 18 с.
2. Сеславин А.И. Исследование операций и методы оптимизации: учебное пособие/ Сеславин А.И., Сеславина Е.А.– Электрон. текстовые данные.– М.: Учебно-методический центр по образованию на железнодорожном транспорте, 2015.– 200 с.
3. Казанская О.В. Модели и методы оптимизации. Практикум: учебное пособие/ Казанская О.В., Юн С.Г., Альсова О.К.– Электрон. текстовые данные.– Новосибирск: Новосибирский государственный технический университет, 2012.– 204 с.
4. Аттетков А.В. Введение в методы оптимизации: учебное пособие/ Аттетков А.В., Зарубин В.С., Канатников А.Н.– Электрон. текстовые данные.– М.: Финансы и статистика, 2014.– 272 с.
5. Методы оптимизации: учебное пособие/ О.А. Васильева [и др.].– Электрон. текстовые данные.– М.: Московский государственный строительный университет, ЭБС АСВ, 2014.– 96 с.

б) дополнительная литература:

1. Сухарев А.Г. Курс методов оптимизации [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Сухарев А.Г., Тимохов А.В., Федоров В.В.– Электрон. текстовые данные.– М.: ФИЗМАТЛИТ, 2011.– 367 с.

2. Розова В.Н. Методы оптимизации [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Розова В.Н., Максимова И.С.– Электрон. текстовые данные.– М.: Российский университет дружбы народов, 2010.– 112 с.
3. Пантелеев А.В. Методы оптимизации [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Пантелеев А.В., Летова Т.А.– Электрон. текстовые данные.– М.: Логос, 2011.– 424 с.

в) периодические издания:

1. «Информационные технологии» Ежемесячный теоретический и прикладной научно-технический журнал ISSN 1684-6400 Подписной индекс 72656
2. Журнал «Бизнес-информатика» – рецензируемый междисциплинарный научный журнал, выпускаемый с 2007 года Национальным исследовательским университетом «Высшая школа экономики» (НИУ ВШЭ). Администрирование журнала осуществляется Школой бизнес-информатики НИУ ВШЭ.
3. Журнал «Вестник Института экономики РАН» –
4. Журнал «Вестник компьютерных и информационных технологий»
5. Журнал «Вестник МГУ: экономика»
6. Журнал «Вестник Российского экономического университета им. Плеханова»
7. Журнал «Вестник финансового университета»
8. Журнал «Вопросы экономики»
9. Журнал «Вычислительные технологии»

в) интернет-ресурсы:

Ресурсы для дистанционного освоения курса, размещенные на сайте www.cs.vlsu.ru.

Современные информационные системы для создания и реализации математических методов в экономике и финансах:

1. Mathcad – программное средство, среда для выполнения на компьютере разнообразных математических и технических расчетов, снабженная простым в освоении и в работе графическим интерфейсом, которая предоставляет пользователю инструменты для работы с формулами, числами, графиками и текстами. В среде Mathcad доступны более сотни операторов и логических функций, предназначенных для численного и символьного решения математических задач различной сложности (<http://www.ptc.com>).
2. MatLab – высокоуровневый язык и интерактивная среда для программирования, численных расчетов и визуализации результатов. С помощью MATLAB можно анализировать данные, разрабатывать алгоритмы, создавать модели и приложения (<http://matlab.ru>).
3. Maple – одна из наиболее популярных систем символьных вычислений, обладающая превосходной научной графикой (<http://www.maplesoft.com>).
4. Power Sim Constructor, Power Sim Studio – программное обеспечение Powersim включает в себя различные типы инструментов имитационного моделирования (<http://powersim.ru>)
5. Anylogic AnyLogic - инструмент имитационного моделирования (<http://www.anylogic.ru>)
6. BPWin – мощный инструмент моделирования, разработанный фирмой Computer Associates Technologies который используется для анализа, документирования и реорганизации сложных бизнес-процессов. Модель, созданная средствами BPwin, позволя-

ет четко документировать различные аспекты деятельности - действия, которые необходимо предпринять, способы их осуществления, требующиеся для этого ресурсы и др. (<http://www.ca.com>).

Интернет-ресурсы, базы данных, информационно-справочные и поисковые системы по тематике дисциплины:

1. <http://www.exponenta.ru> – Образовательный математический портал.
2. <http://www.kxlab.com> - сайт _kx Лаборатории. Отправная точка поиска информации о новейших научных разработках в области вычислительной математики, автоматизации моделирования и программных продуктах _kx Лаборатории.
3. www.mathhelpplanet.com - некоммерческий математический форум, на котором можно получить консультацию и реальную помощь в решении по практически любому вопросу, связанному с математикой и многочисленными её приложениями.
4. www.csin.ru - Образовательный интернет-проект, посвященный computer science и смежным дисциплинам. Мы формируем комьюнити людей, профессионально занимающихся или даже просто интересующихся данной тематикой. Также мы собираем информацию, например, русскоязычные курсы по информатике.
5. www.teorver.ru - Портал, посвященный таким разделам математики, как теория вероятностей, математическая статистика, теория массового обслуживания, математическая теория телеграфа и другим приложениям теории вероятностей.
6. <http://edu.ru> - Федеральный портал "Российское образование", поддерживаемый ФГУ ГНИИ ИТТ "Информика". Каталог интернет-ресурсов по предметам.
7. <http://www.mathtree.ru> - Древовидный каталог математических ресурсов содержит информацию о кафедрах, персонах, публикациях, библиотеках, журналах и т.п.
8. <http://www.mathnet.ru/> - Общероссийский математический портал, предоставляющий российским и зарубежным математикам различные возможности в поиске информации о математической жизни в России.
9. <http://algotlist.manual.ru> - Сайт, посвященный алгоритмам и методам программирования.
10. <http://www.ecsocman.edu.ru/> - Образовательный портал - экономика, социология, менеджмент.
11. <http://www.fea.ru/> - Портал лаборатории "Вычислительная механика" физикомеханического факультета СПбГУ.

8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Лекционные аудитории, оснащённые доской (для мела или маркера), экраном для проекционных систем, проектором и ноутбуком.

Аудитории для проведения лабораторных занятий, оснащённые современными персональными компьютерами, объединёнными в локальную вычислительную сеть и укомплектованными необходимым системным и прикладным программным обеспечением, аудитории вычислительного центра.

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению 02.03.03 Математическое обеспечение и администрирование информационных систем.

Рабочую программу составил доцент кафедры ФиПМ _____ Абрахин С.И.

Рецензент

(представитель работодателя)

 Квасов Д.С. Ген. директор ООО "Н Сервис"
(место работы, должность, ФИО, подпись)

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры ФиПМ

Протокол № 11А от 17.04.15 года

Заведующий кафедрой _____ Аракелян С.М.
(ФИО, подпись)

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии направления 02.03.03 Математическое обеспечение и администрирование информационных систем.

Протокол № 11А от 17.04.15 года

Председатель комиссии _____ Аракелян С.М.
(ФИО, подпись)

ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____