**Nazwa przedmiotu:**

Teoria i metody optymalizacji

**Koordynator przedmiotu:**

dr hab. inż. Radosław Pytlak, prof. nzw. PW

**Status przedmiotu:**

Fakultatywny dowolnego wyboru

**Poziom kształcenia:**

Studia II stopnia

**Program:**

Automatyka i Robotyka

**Grupa przedmiotów:**

Wariantowe

**Kod przedmiotu:**

TMO

**Semestr nominalny:**

1 / rok ak. 2016/2017

**Liczba punktów ECTS:**

4

**Liczba godzin pracy studenta związanych z osiągnięciem efektów uczenia się:**

**Liczba punktów ECTS na zajęciach wymagających bezpośredniego udziału nauczycieli akademickich:**

**Język prowadzenia zajęć:**

polski

**Liczba punktów ECTS, którą student uzyskuje w ramach zajęć o charakterze praktycznym:**

**Formy zajęć i ich wymiar w semestrze:**

|  |  |
| --- | --- |
| Wykład:  | 450h |
| Ćwiczenia:  | 0h |
| Laboratorium:  | 225h |
| Projekt:  | 0h |
| Lekcje komputerowe:  | 0h |

**Wymagania wstępne:**

algebra liniowa, analiza matematyczna, metody numeryczne

**Limit liczby studentów:**

**Cel przedmiotu:**

Wprowadzenie do teorii optymalizacji. Wprowadzenie do metod obliczeniowych optymalizacji. Wprowadzenie do pakietów numerycznych optymalizacji.

**Treści kształcenia:**

Wprowadzenie do optymalizacji: sformułowanie zadania optymalizacji; metody obliczeniowe optymalizacji; zastosowania metod optymalizacji (planowanie produkcji, alokacja zasobów, budowa modeli) - 2g. Optymalizacja bez ograniczeń: warunki konieczne optymalizacji: rozwiązania lokalne i globalne; warunki konieczne optymalności pierwszego i drugiego rzędu; warunki dostateczne optymalności; zbiory i funkcje wypukłe - 4g. Metody gradientowe dla zadań bez ograniczeń: metoda największego spadku; metoda Newtona; metoda gradientów sprzężonych; metoda zmiennej metryki - 2g. Analiza zbieżności metod gradientowych: metody określania kierunków poprawy; metody wyznaczania współczynników kroku; ogólne warunki zbieżności dla reguły Armijo oraz reguł Wolfe’a - 2g. Szybkość zbieżności procesów iteracyjnych: zbieżność liniowa, zbieżność superliniowa; zbieżność kwadratowa - 2g. Ogólne twierdzenie zbieżności metod z minimalizacją w kierunku - 2g. Metody obszarów zaufania: model liniowy; model kwadratowy - 2g. Metoda Newtona: lokalna metoda Newtona; szybkość zbieżności metody Newtona; globalna metoda Newtona - 2g. Metoda gradientów sprzężonych, skalowana metoda gradientów sprzężonych - 2g. Metody zmiennej metryki: szybkość zbieżności metod zmiennej metryki; metoda BFGS; metoda BFGS o ograniczonej pamięci - 2g. Warunki konieczne optymalności KKT dla zadań z ograniczeniami, warunki regularności ograniczeń - 2g. Metoda sympleks dla zadań liniowych - 2g. Metoda punktu wewnętrznego dla zadań liniowych - 2g. Metody dla zadań z ograniczeniami: metoda funkcji kary, metoda rozszerzonego Lagrange'a, metoda SQP - 2g.

**Metody oceny:**

egzamin pisemny (waga 0.5), sprawozdania z laboratoriów przygotowane na laboratorium (waga 0.5)

**Egzamin:**

**Literatura:**

1) Stachurski, A., Wierzbicki, A., „Podstawy optymalizacji”, Wyd. PW, 2002.
2) Findeisen, W., Szymanowski, J, Wierzbicki, A, “Teoria i metody obliczeniowe optymalizacji”, PWN, 1977.
3) Nocedal, J., Wright, S., “Numerical optimization”, Springer, 2006.
4) Pytlak, R., „Numerical methods for optimal control problems with state constraints”, Springer, 1999.

**Witryna www przedmiotu:**

**Uwagi:**

## Efekty przedmiotowe

### Profil ogólnoakademicki - wiedza

**Efekt TMO\_IIst\_K\_W01:**

Posiada wiedzę dotyczącą teorii i metod optymalizacji oraz narzędzi wykorzystywanych przy rozwiązywanie zadań z zakresu optymalizacji numerycznej

Weryfikacja:

Egzamin. Ocena ze wszystkich ćwiczeń laboratoryjnych

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_W01, K\_W04, K\_W05

**Powiązane efekty obszarowe:** T2A\_W01, T2A\_W03, T2A\_W04

### Profil ogólnoakademicki - umiejętności

**Efekt TMO\_IIst\_K\_U01:**

Potrafi wykorzystać algorytmy optymalizacji dla zadania sterowania obiektami automatyki

Weryfikacja:

Egzamin. Ocena ze wszystkich ćwiczeń laboratoryjnych

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_U06, K\_U11

**Powiązane efekty obszarowe:** T2A\_U10, T2A\_U18, T2A\_U11

### Profil ogólnoakademicki - kompetencje społeczne

**Efekt TMO\_IIst\_K\_K01:**

Potrafi pracować w zespole. Zarówno w roli koordynatora zadania, określając właściwą kolejność jego realizacji, jak również osoby będącej członkiem zespołu koordynowanego przez inną osobę.

Weryfikacja:

Ocena z wykonania laboratoriów

**Powiązane efekty kierunkowe:** K\_K04, K\_K05

**Powiązane efekty obszarowe:** T2A\_K03, T2A\_K04