

Pós Graduação em Ciência da Computação
DCC-808 Programação Não Linear
Plano da disciplina para o semestre 2018/1

Prof. Alexandre Salles da Cunha

acunha@dcc.ufmg.br

Dezembro de 2017

1 Objetivos do curso

- Apresentar a teoria que fundamenta várias classes de algoritmos de otimização para problemas não lineares, convexos ou não.
- Apresentar alguns dos principais algoritmos para a resolução de problemas de otimização não-linear, diferenciáveis, convexos ou não. O caso não diferenciável não será tratado.

Observação: Não serão discutidos algoritmos de otimização global para o caso diferenciável não convexo. Para estes problemas, os algoritmos abordados no curso fornecem soluções ótimas locais.

2 Plano de Curso

A primeira parte do curso apresenta uma revisão de conceitos matemáticos importantes em otimização: Álgebra Linear Computacional e Análise Convexa. Em seguida, são apresentadas condições necessárias e suficientes para otimalidade para problemas de otimização não linear irrestritos diferenciáveis, bem como algoritmos (Gradiente, Newton, Direções Conjugadas, Quasi-Newton) para esta classe de problemas. Na sequência, são discutidas condições de regularidade, condições necessárias e suficientes para otimalidade local de problemas de otimização não linear, diferenciáveis, sujeitos à restrições de desigualdades e de igualdades. Também é discutida Teoria da Dualidade (Lagrangeana e de Fenchel). Por fim, são apresentados os algoritmos dedicados à resolução de problemas de otimização não linear com restrições: Métodos primais (Gradiente Condicional, Projeção do Gradiente, Simplex convexo), métodos baseados em penalidades exterior e interior (penalidades, penalidades exatas, barreira, pontos interiores) e métodos baseados em multiplicadores de Lagrange (Método do Lagrangeano Aumentado).

Parte 1 Revisão de fundamentos matemáticos

- Álgebra Linear Computacional
- Conjuntos e funções convexas

Parte 2 Otimização não-linear irrestrita

- Condições necessárias e suficientes de otimalidade para problemas irrestritos e sobre conjuntos convexos.
- Métodos do tipo Gradiente
- Método de Newton
- Métodos de Direções conjugadas, Gradiente Conjugado,
- Métodos Quasi-Newton
- Análise de ordem e taxa de convergência destes métodos para o caso quadrático convexo.

Parte 3 Otimização não linear com restrições:

- Condições necessárias e suficientes para problemas com restrições de igualdade e desigualdade.
- Métodos primais
- Dualidade Lagrangeana
- Condições de Slater
- Funções conjugadas
- Programação Quadrática Sequencial (SQP)
- Métodos de Penalidades
- Métodos de Pontos Interiores
- Método do Lagrangeano Aumentado

3 Bibliografia

O curso é baseado em três livros clássicos de Programação Não Linear [2, 1, 7] e no livro de Otimização Convexa [4]. Os livros citados também cobrem, seja em seus capítulos introdutórios ou em seus apêndices, uma boa revisão dos conceitos matemáticos necessários. Para a parte de Álgebra Linear Computacional, Análise Convexa e Cálculo, são sugeridos como referências complementares os livros [8, 9], [6, 3] e [5], respectivamente.

4 Avaliação

- 2 provas totalizando 50 pontos. A primeira prova, valorada em 25 pontos, cobre o conteúdo da segunda parte do curso. A segunda prova, igualmente valorada em 25 pontos, cobre o conteúdo da parte final do curso. O conteúdo da revisão de fundamentos matemáticos, por permear todo o restante do curso, não será explicitamente avaliada nas provas, apenas por meio de uma lista de exercícios específica.
- 3 listas de exercícios totalizando 50 pontos. A cada parte do curso, compreende uma lista. A primeira delas valerá 10 pontos e as demais valerão 20 pontos cada.

Observação: As provas e listas de exercícios são individuais.

Referências

- [1] BAZARAA, M., SHERALI, H., E SHETTY, C. *Nonlinear Programming: Theory and Algorithms*, Third ed. Wiley-Interscience, 2006.

- [2] BERTSEKAS, D. *Nonlinear Programming*, Third ed. Athena Scientific, 2016.
- [3] BERTSEKAS, D. P. *Convex Optimization Theory*. Athena Scientific, 2009.
- [4] BOYD, S., E VANDERBERGHE, L. *Convex Optimization*. Cambridge University Press, 2007.
<http://www.stanford.edu/~boyd/cvxbook/>.
- [5] BUCK, R. C. *Advanced Calculus*. Waveland Pr Inc, 2003. Third edition.
- [6] HIRIART-URRUTY, J., E LEMARÉCHAL, C. *Fundamentals of Convex Analysis*, 2nd ed. Springer, 2004.
- [7] LUENBERGER, D. *Linear and Nonlinear Programming*. Springer, 2008.
- [8] TREFETHEN, L AND BAU III, D. *Numerical Linear Algebra*. SIAM, 1996.
- [9] WATKINS, D. S. *Fundamentals of Matrix Computations*. Wiley, 2010.