

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

**Федеральное государственное автономное
образовательное учреждение высшего образования
«Национальный исследовательский Нижегородский государственный университет
им. Н.И. Лобачевского»**

Институт информационных технологий, математики и механики

(факультет / институт / филиал)

УТВЕРЖДАЮ:

директор института

_____ В.П. Гергель

« ____ » _____ 2020

Рабочая программа дисциплины

**Вариационное исчисление и
методы оптимизации**

(наименование дисциплины (модуля))

Уровень высшего образования
_____ специалитет

(бакалавриат / магистратура / специалитет)

Направление подготовки / специальность

010501 Фундаментальная математика и механика

(указывается код и наименование направления подготовки / специальности)

Направленность образовательной программы

Фундаментальная механика и приложения

(указывается профиль / магистерская программа / специализация)

Форма обучения

_____ очная

(очная / очно-заочная / заочная)

Нижегород

2020год

Лист актуализации

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК
_____ 2019 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2019-2020 учебном году на заседании кафедры

Протокол от _____ 20__ г. № ____
Зав. кафедрой _____

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК
_____ 20__ г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2020-2021 учебном году на заседании кафедры

Протокол от _____ 20__ г. № ____
Зав. кафедрой _____

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК
_____ 20__ г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2021-2022 учебном году на заседании кафедры

Протокол от _____ 20__ г. № ____
Зав. кафедрой _____

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК
_____ 20__ г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2022-2023 учебном году на заседании кафедры

Протокол от _____ 20__ г. № ____
Зав. кафедрой _____

1. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина относится к обязательной части

Б1.О.20 Вариационное исчисление и методы оптимизации

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы (компетенциями и индикаторами достижения компетенций)

Формируемые компетенции (код, содержание компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), в соответствии с индикатором достижения компетенции		Наименование оценочного средства
	Индикатор достижения компетенции* (код, содержание индикатора)	Результаты обучения по дисциплине**	
ОПК-1 Способен находить, формулировать и решать актуальные и значимые проблемы фундаментальной математики и механики	ОПК-1.1.: Знает основы фундаментальных физико-математических дисциплин и других естественных наук	Знать классические постановки задач конечномерной и бесконечномерной оптимизации, основные численные методы оптимизации, а также аналитические методы решения задач оптимизации на основе необходимых и достаточных условий оптимальности	собеседование
	ОПК-1.2.: Умеет формулировать, анализировать и решать профессиональные задачи с применением фундаментальных знаний математики, физики и других естественных наук	Уметь самостоятельно и корректно использовать методы формализации практических и естественнонаучных задач в виде задач оптимизации, допускающих такую формализацию, а также применять для их решения численные методы оптимизации и аналитические методы решения задач оптимизации на основе необходимых и достаточных условий оптимальности	задачи
	ОПК-1.3.: Имеет практический опыт постановки и решения актуальных задач математики и механики	Иметь практический опыт использования методов формализации прикладных и естественнонаучных задач, возникающих из потребностей научно-исследовательской деятельности, в виде задач оптимизации, при условии, что они допускают такую формализацию, а также применения для их решения численных методов оптимизации и аналитических методов решения задач оптимизации на основе необходимых и достаточных условий оптимальности	задачи
ОПК-2 Способен создавать, анализировать и реализовывать новые математические модели в современном естествознании, тех-	ОПК-2.1.: Знает основные положения, терминологию и методологию в области математического и алгоритмического моделирования	Знать основные положения, терминологию и методологию в области вариационного исчисления и методов оптимизации	собеседование
	ОПК-2.2.: Умеет осуществлять анализ и выбор методов решения задач профес-	Уметь осуществлять анализ и выбор методов решения задач профессиональной и научной деятельности на основе теоретических знаний в области вариационного исчисления и методов	задачи

нике, экономике и управлении	сиональной и научной деятельности на основе теоретических знаний в области математических и компьютерных наук	оптимизации	
	ОПК-2.3.: Имеет практический опыт разработки новых методов математического моделирования для решения задач профессиональной и научной деятельности	Иметь практический опыт разработки новых методов математического моделирования для решения задач профессиональной и научной деятельности на основе теоретических знаний в области вариационного исчисления и методов оптимизации	задачи

3. Структура и содержание дисциплины

3.1. Трудоемкость дисциплины

	очная форма обучения
Общая трудоемкость	8 ЗЕТ
Часов по учебному плану	288
в том числе	
контактная работа:	131
- занятия лекционного типа	64
- занятия семинарского типа	64
- текущий контроль (КСР)	3
самостоятельная работа	121
Промежуточная аттестация – зачет, экзамен	36

3.2. Содержание дисциплины

Наименование и краткое содержание разделов и тем дисциплины	Всего (часы)	в том числе				
		контактная работа (работа во взаимодействии с преподавателем), часы				Самостоятельная работа обучающегося, часы
		из них				
		Занятия лекционного типа	Занятия семинарского типа	Занятия лабораторного типа	Всего контактных часов	
Седьмой семестр						
Тема 1. Элементарный выпуклый анализ. Выпуклые множества. Выпуклые конусы. Возмож-	25		6		6	19

ные направления. Выпуклые функции. Критерии выпуклости. Точки минимума выпуклых функций.						
Тема 2. Гладкие конечномерные задачи на экстремум. Теорема Вейерштрасса и ее следствия. Безусловный минимум: необходимые условия минимума первого и второго порядков, достаточные условия. Условный минимум: принцип Лагранжа в задачах с ограничениями типа равенства и неравенства, регулярность, гладко-выпуклые задачи, условия второго порядка.	37	8	9		17	20
Тема 3. Выпуклые конечномерные задачи на экстремум. Различные формы записи задач выпуклого программирования. Теорема Куна-Таккера. Теория двойственности. Случай задач линейного программирования.	43	14	9		23	20
Тема 4. Численные методы конечномерной оптимизации. Терминология. Классификация методов. Одномерный поиск для унимодальных и липшицевых функций. Безусловная минимизация функций нескольких переменных: градиентные методы, метод Ньютона, методы сопряженных направлений для квадратичных функций, метод сопряженных градиентов. Условная минимизация функций нескольких переменных: методы штрафных функций, симплекс-метод решения задач линейного программирования.	38	10	8		18	20
Текущий контроль (КСР)	1				1	
Промежуточная аттестация - зачет						
Итого за семестр	144	32	32		65	79
Восьмой семестр						
Тема 5. Простейшая задача varia-	26	8	8		16	10

<p>ционного исчисления и ее обобщения. Условия первого порядка.</p> <p>Простейшая задача: классификация экстремумов, варьирование, необходимые условия первого порядка (стационарность, уравнение Эйлера), конкретные примеры (задачи о брахистохроне и о наименьшей поверхности вращения). Принцип Гамильтона-Остроградского и его применения. Обобщения простейшей задачи: экстремальные задачи на линейных многообразиях в линейных нормированных пространствах, задачи со старшими производными, задачи с вектор-функциями, задачи с функциями нескольких переменных, задачи с подвижными границами, задачи на классе кусочно-гладких функций,</p>						
<p>Тема 6.</p> <p>Условия второго порядка в вариационном исчислении. Условия второго порядка в простейшей задаче вариационного исчисления: необходимые условия Лежандра и Якоби слабого минимума, необходимое условие Вейерштрасса сильного минимума, достаточные условия локального минимума.</p>	26	8	8		16	10
<p>Тема 7.</p> <p>Принцип Лагранжа в вариационном исчислении. Вариационные задачи с ограничениями.</p> <p>Изопериметрические задачи. Задачи со связями. Задача Лагранжа. Конкретные примеры: задача Дидоны, задача о цепной линии, задача Чаплыгина о самолете.</p>	26	8	8		16	10
<p>Тема 8.</p> <p>Понятие о математической теории оптимального управления.</p> <p>Управляемые системы.</p>	28	8	8		16	12

Задачи оптимального управления классического вариационного типа (без ограничений на значения управления). Задачи оптимального управления понтрягинского типа (с ограничениями на значения управления). Принцип максимума Понтрягина. Конкретные иллюстративные примеры.						
Текущий контроль (КСР)	2				2	
Промежуточная аттестация - экзамен	36					
Итого за семестр	144	32	32		66	42
Итого	288	64	64		131	121

Текущий контроль успеваемости реализуется в форме опросов на занятиях семинарского типа. Промежуточная аттестация проходит в традиционной форме (зачет, экзамен).

4. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся

Самостоятельная работа студента при изучении дисциплины «Методы оптимизации» включает выполнение заданий под контролем преподавателя, решение домашних заданий и подготовку к зачету и экзамену. Самостоятельная работа студентов (выполнение домашних практических заданий, подготовка к коллоквиуму, экзамену и зачету) обеспечивается доступной студентам основной и дополнительной литературой, а также доступными им интернет-ресурсами (см. ниже раздел **6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины**).

Для подготовки к зачету по темам 1 - 3, связанным с математическим программированием, студентам можно воспользоваться:

1. Сумин В.И. Начала математического программирования. Теорема Вейерштрасса. Безусловный экстремум. Электронное учебно-методическое пособие. Нижний Новгород: Нижегородский госуниверситет, 2015. – 40 с. (<http://www.unn.ru/books/resources.html>, Регистрационный номер 973.15.06).
2. Сумин В.И. Начала выпуклого анализа. Часть 1. Выпуклые множества. Электронное учебно-методическое пособие. Нижний Новгород: Нижегородский госуниверситет, 2015. – 32 с. (<http://www.unn.ru/books/resources.html>, Регистрационный номер 974.15.06).
3. Сумин В.И. Начала выпуклого анализа. Часть 2. Выпуклые функции. Электронное учебно-методическое пособие. Нижний Новгород: Нижегородский госуниверситет, 2015. – 28 с. (<http://www.unn.ru/books/resources.html>, Регистрационный номер 975.15.06).

Указанные пособия содержат теоретический материал с иллюстрирующими подробными примерами и упражнениями для самостоятельного выполнения.

Для подготовки к зачету и экзамену по темам 4,5, связанным с численными методами оптимизации и простейшей задачей вариационного исчисления, студентам можно воспользоваться:

1. Сумин В.И. Симплекс-метод решения задач линейного программирования. Методическая разработка по курсу "Методы оптимизации". - Горький: Изд-во ГГУ, 1989 (40).
2. Чернов А.В. Применение системы MATLAB к решению простейшей задачи вариационного исчисления. Н.Новгород: ННГУ, 2007 (85).
3. Чернов А.В. Численные методы одномерной минимизации. Н.Новгород: ННГУ, 2009 (62).

4. Чернов А.В. Численные методы безусловной минимизации функций многих переменных. Н.Новгород: ННГУ, 2010 (52).
5. Чернов А.В. Численные методы условной минимизации функций многих переменных. Н.Новгород: ННГУ, 2010 (70).

Указанные пособия содержат теоретический материал с иллюстрирующими подробными примерами и упражнениями для самостоятельного выполнения, а также примеры программ на языке MATLAB и задания для выполнения лабораторных работ.

Контрольные вопросы и задания для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины приведены в п. 5.2.

5. Фонд оценочных средств для промежуточной аттестации по дисциплине, включающий:

5.1. Описание шкал оценивания результатов обучения по дисциплине

Уровень сформированности компетенций (индикатора достижения компетенций)	Шкала оценивания сформированности компетенций						
	плохо	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	очень хорошо	отлично	превосходно
	Не зачтено		зачтено				
<u>Знания</u>	Отсутствие знаний теоретического материала. Невозможность оценить полноту знаний вследствие отказа обучающегося от ответа	Уровень знаний ниже минимальных требований. Имели место грубые ошибки.	Минимально допустимый уровень знаний. Допущено много негрубых ошибок.	Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки. Допущено несколько негрубых ошибок	Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки. Допущено несколько несущественных ошибок	Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки, без ошибок.	Уровень знаний в объеме, превышающем программу подготовки.
<u>Умения</u>	Отсутствие минимальных умений. Невозможность оценить наличие умений вследствие отказа обучающегося от ответа	При решении стандартных задач не продемонстрированы основные умения. Имели место грубые ошибки.	Продemonстрированы основные умения. Решены типовые задачи с негрубыми ошибками. Выполнены все задания, но не в полном объеме.	Продemonстрированы все основные умения. Решены все основные задачи с негрубыми ошибками. Выполнены все задания, в полном объеме, но некоторые с недочетами.	Продemonстрированы все основные умения. Решены все основные задачи. Выполнены все задания, в полном объеме, но некоторые с недочетами.	Продemonстрированы все основные умения, решены все основные задачи с отдельными несущественными недочетами, выполнены все задания в полном объеме.	Продemonстрированы все основные умения, Решены все основные задачи. Выполнены все задания, в полном объеме без недочетов

<u>Навыки</u>	Отсутствие владения материалом. Невозможность оценить наличие навыков вследствие отказа обучающегося от ответа	При решении стандартных задач не продемонстрированы базовые навыки. Имели место грубые ошибки.	Имеется минимальный набор навыков для решения стандартных задач с некоторыми недочетами	Продемонстрированы базовые навыки при решении стандартных задач с некоторыми недочетами	Продемонстрированы базовые навыки при решении стандартных задач без ошибок и недочетов.	Продемонстрированы навыки при решении нестандартных задач без ошибок и недочетов.	Продемонстрирован творческий подход к решению нестандартных задач
---------------	--	---	---	--	--	--	---

Шкала оценки при промежуточной аттестации

Оценка		Уровень подготовки
зачтено	Превосходно	Все компетенции (части компетенций), на формирование которых направлена дисциплина, сформированы на уровне не ниже «превосходно»
	Отлично	Все компетенции (части компетенций), на формирование которых направлена дисциплина, сформированы на уровне не ниже «отлично», при этом хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «отлично»
	Очень хорошо	Все компетенции (части компетенций), на формирование которых направлена дисциплина, сформированы на уровне не ниже «очень хорошо», при этом хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «очень хорошо»
	Хорошо	Все компетенции (части компетенций), на формирование которых направлена дисциплина, сформированы на уровне не ниже «хорошо», при этом хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «хорошо»
	Удовлетворительно	Все компетенции (части компетенций), на формирование которых направлена дисциплина, сформированы на уровне не ниже «удовлетворительно», при этом хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «удовлетворительно»
не зачтено	Неудовлетворительно	Хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «неудовлетворительно», ни одна из компетенций не сформирована на уровне «плохо»
	Плохо	Хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «плохо»

5.2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки результатов обучения

5.2.1. Контрольные вопросы

Вопрос	Код формируемой компетенции
1. Определение и простейшие свойства выпуклых множеств.	ОПК-1, ОПК-2

2. Граничные точки выпуклых множеств.	ОПК-1, ОПК-2
3. Проекция точки на множество. Теоремы о проекции.	ОПК-1, ОПК-2
4. Неотрицательная и выпуклая комбинации точек.	ОПК-1, ОПК-2
5. Коническая и выпуклая оболочки множества.	ОПК-1, ОПК-2
6. Теоремы отделимости выпуклых множеств.	ОПК-1, ОПК-2
7. Опорные гиперплоскости.	ОПК-1, ОПК-2
8. Сопряженный конус. Теорема Фаркаша.	ОПК-1, ОПК-2
9. Возможные (допустимые) направления.	ОПК-1, ОПК-2
10. Определение выпуклой функции и его геометрический смысл. Простейшие свойства выпуклых функций.	ОПК-1, ОПК-2
11. Дифференцируемость выпуклой функции по возможным направлениям.	ОПК-1, ОПК-2
12. Свойство непрерывности выпуклой функции.	ОПК-1, ОПК-2
13. Критерии выпуклости в классе дифференцируемых функций нескольких переменных.	ОПК-1, ОПК-2
14. Критерий выпуклости в классе дважды дифференцируемых функций многих переменных.	ОПК-1, ОПК-2
15. Точки минимума выпуклых функций. Критерий точки минимума выпуклой функции.	ОПК-1, ОПК-2
16. Сильно выпуклые функции.	ОПК-1, ОПК-2
17. Понятие о математической теории оптимизации и математическом программировании (МП) как одном из ее разделов. Примеры задач оптимизации.	ОПК-1, ОПК-2
18. Теорема Вейерштрасса и ее следствия.	ОПК-1, ОПК-2
19. Гладкие задачи на безусловный экстремум. Необходимые условия первого порядка.	ОПК-1, ОПК-2
20. Гладкие задачи на безусловный экстремум. Необходимые условия второго порядка.	ОПК-1, ОПК-2
21. Гладкие задачи на безусловный экстремум. Достаточные условия второго порядка.	ОПК-1, ОПК-2
22. Направления спуска. Необходимое условие оптимальности в общей задаче минимизации. Необходимое и достаточное условия направления спуска для дифференцируемых функций.	ОПК-1, ОПК-2
23. Гладкие задачи на условный экстремум. Необходимое условие оптимальности первого порядка.	ОПК-1, ОПК-2
24. Гладкие задачи на условный экстремум. Необходимое условие оптимальности в классе дважды дифференцируемых функций.	ОПК-1, ОПК-2

25. Гладкие задачи на условный экстремум. Достаточное условие оптимальности в классе дважды дифференцируемых функций	ОПК-1, ОПК-2
26. Классификация задач математического программирования.	ОПК-1, ОПК-2
27. Принцип Лагранжа и его геометрический смысл.	ОПК-1, ОПК-2
28. Достаточное условие глобального минимума в задаче выпуклого программирования.	ОПК-1, ОПК-2
29. Простейшее условие регулярности в задаче математического программирования.	ОПК-1, ОПК-2
30. Достаточные условия регулярности в задаче математического программирования: условие Слейтера.	ОПК-1, ОПК-2
31. Достаточные условия регулярности в задаче математического программирования: условие линейности.	ОПК-1, ОПК-2
32. Необходимые условия второго порядка в задаче математического программирования.	ОПК-1, ОПК-2
33. Достаточные условия второго порядка в задаче математического программирования	ОПК-1, ОПК-2
34. Выпуклое программирование. Теорема Куна-Таккера в дифференциальной форме.	ОПК-1, ОПК-2
35. Понятие седловой точки функции Лагранжа. Критерий седловой точки.	ОПК-1, ОПК-2
36. Теорема Куна-Таккера в форме утверждения о седловой точке. Связь с теоремой Куна-Таккера в дифференциальной форме.	ОПК-1, ОПК-2
37. Понятие двойственной задачи и ее свойства.	ОПК-1, ОПК-2
38. Теорема двойственности.	ОПК-1, ОПК-2
39. Теорема Куна-Таккера в форме двойственности.	ОПК-1, ОПК-2
40. Теорема существования решения в задачах ЛП.	ОПК-1, ОПК-2
41. Теория двойственности для задач ЛП	ОПК-1, ОПК-2
42. Классификация численных методов оптимизации.	ОПК-1, ОПК-2
43. Метод дихотомии.	ОПК-1, ОПК-2
44. Метод половинного деления.	ОПК-1, ОПК-2
45. Метод золотого сечения.	ОПК-1, ОПК-2
46. Безусловная минимизация функций многих переменных: овражный эффект.	ОПК-1, ОПК-2
47. Безусловная минимизация функций многих переменных: метод наискорейшего спуска. Теорема о сходимости.	ОПК-1, ОПК-2
48. Безусловная минимизация функций многих переменных: метод Ньютона: идея, алгоритм, достоинства и недостатки,	ОПК-1, ОПК-2

сравнение с градиентными методами.	
49. Условная минимизация функций многих переменных: метод проекции градиента. Теорема о сходимости.	ОПК-1, ОПК-2
50. Условная минимизация функций многих переменных: метод условного градиента. Теорема о сходимости.	ОПК-1, ОПК-2
51. Условная минимизация функций многих переменных: метод квадратичного штрафа.	ОПК-1, ОПК-2
52. Симплекс-метод решения задач линейного программирования: каноническая задача ЛП. Приведение задач ЛП к каноническому виду.	ОПК-1, ОПК-2
53. Основные определения симплекс-метода: вершина, ребро, базис вершины. Соответствие между вершинами и базисами. Ребра, выходящие из невырожденной вершины.	ОПК-1, ОПК-2
54. Итерационный алгоритм симплекс-метода в невырожденном случае. Итерационные формулы. Симплекс-таблица (СТ). Анализ и пересчет СТ.	ОПК-1, ОПК-2
55. Симплекс-метод решения задач линейного программирования: отыскание начальной вершины методом искусственного базиса	ОПК-1, ОПК-2
56. Простейшая задача вариационного исчисления. Классификация экстремумов. Экстремали функционала и экстремали задачи.	ОПК-1, ОПК-2
57. Основные леммы вариационного исчисления.	ОПК-1, ОПК-2
58. Необходимые условия слабого локального экстремума в простейшей задаче вариационного исчисления. Уравнение Эйлера.	ОПК-1, ОПК-2
59. Задача о брахистохроне.	ОПК-1, ОПК-2
60. Задачи вариационного исчисления со старшими производными. Уравнение Эйлера-Пуассона.	ОПК-1, ОПК-2
61. Задачи вариационного исчисления с вектор-функциями. Система уравнений Эйлера.	ОПК-1, ОПК-2
62. Задачи вариационного исчисления с функциями нескольких переменных. Уравнение Эйлера-Остроградского.	ОПК-1, ОПК-2
63. Принцип Гамильтона-Остроградского	ОПК-1, ОПК-2
64. Изопериметрические задачи: постановка, принцип Лагранжа, условия регулярности.	ОПК-1, ОПК-2
65. Задача Дидоны	ОПК-1, ОПК-2
66. Задача Лагранжа	ОПК-1, ОПК-2
67. Задача оптимального управления классического типа. Необходимые условия оптимальности	ОПК-1, ОПК-2
68. Задача оптимального управления понтрягинского типа. Принцип максимума Л.С.Понтрягина	ОПК-1, ОПК-2

5.2.2. Типовые тестовые задания для оценки сформированности компетенции

Вариант 1

Задача 1. Проверить на выпуклость функцию $f(x) = (x_1)^2 - x_1x_2 + (x_2)^2$ на множестве $X = R^2$.

Задача 2. Существует ли точка глобального минимума в задаче оптимизации: $f(x, y) = 5x - 3y \rightarrow \min$, $x^2 + y^2 \leq 4$? Почему?

Задача 3. Решить с помощью метода множителей Лагранжа задачу оптимизации: $f(x, y) = 5x - 3y \rightarrow \min$, $x^2 + y^2 \leq 4$.

Задача 4. Решить задачу линейного программирования с помощью теории двойственности:

$$\begin{cases} f(x, y, z) = 2x - y + 3z \rightarrow \min \\ x + 3y - 2z \leq 2, & 2x - y + z = 4, \\ y, z \geq 0. \end{cases}$$

Задача 5. Решить задачу $f(x, y) = x^2 + y^2 \rightarrow \min$ методом Ньютона, начав с точки (1,1).

Задача 6. Решить простейшую задачу вариационного исчисления:

$$J[y] = \int_0^1 [(y')^2 + 2xy] dx \rightarrow \min, \quad y(0) = 1, \quad y(1) = 0.$$

5.2.3. Типовые задачи для оценки сформированности компетенции

Вариант 1 (Выпуклый анализ)

Задание 1. Проверить на выпуклость множество $X = \Gamma_{c,\alpha}$.

Задание 2. Проверить на выпуклость функцию $f(x) = 3(x^1)^2 - x^1 x^2 + (x^2)^2$.

Вариант 2 (Общая задача оптимизации)

Задание 1. Для задачи $f(x) = x^1 + x^2 \rightarrow \min$, $(x^1)^2 + x^2 \leq 1$, $x^2 \geq 0$, построить допустимое множество и линии уровня целевой функции; указать точку глобального минимума (если она существует). Выполняются ли какие-то достаточные условия существования глобального минимума в этой задаче?

Задание 2. Решить задачу безусловной минимизации: $f(x) = 0.5(Ax, x) - (b, x) + c \rightarrow \min$,

$$A = \begin{pmatrix} 3 & -1 \\ -1 & 2 \end{pmatrix}, \quad b = \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix}.$$

Вариант 3 (Гладкие задачи математического программирования)

Задание 1. Решить с помощью метода множителей Лагранжа задачу оптимизации:

$$f(x) = x^1 + x^2 \rightarrow \min, \quad (x^1)^2 + x^2 \leq 1, \quad x^2 \geq 0.$$

Задание 2. Решить с помощью теоремы Куна-Таккера в дифференциальной форме задачу оптимизации:

$$f(x) = 0.5(Ax, x) - (b, x) + c \rightarrow \min, \quad A = \begin{pmatrix} 3 & -1 \\ -1 & 2 \end{pmatrix}, \quad b = \begin{pmatrix} 2 \\ 1 \end{pmatrix}, \quad x^1 + x^2 = 1, \quad x^1, x^2 \geq 0.$$

Вариант 4 (Выпуклое и линейное программирование)

Задание 1. Решить задачу линейного программирования с помощью теории двойственности:

$$\begin{cases} f(x, y, z) = 2y - x + 3z \rightarrow \min \\ 3x + y - 2z \leq 2, & 2y - x + z = 4, \\ x, z \geq 0. \end{cases}$$

Задание 2. Решить ту же задачу с помощью теоремы Куна-Таккера в форме утверждения о седловой точке.

Вариант 5 (Численные методы оптимизации)

Задание 1. Решить задачу $f(x, y) = x^2 + 4y^2 \rightarrow \min$ методом Ньютона, начав с точки $(1, -1)$.

Задание 2. Решить симплекс-методом задачу линейного программирования: $f(x) = (c, x) \rightarrow \min$,

$$Ax = b, \quad x \geq 0, \quad A = \begin{pmatrix} 2, & 1, & 1, & 0 \\ 1, & 3, & 0, & 2 \end{pmatrix}, \quad b = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix}, \quad c = (1, -2, 2, 3).$$

Вариант 6 (Вариационное исчисление)

Задание 1. Решить простейшую задачу вариационного исчисления:

$$J[y] = \int_0^1 [2(y')^2 - 3y] dx \rightarrow \min, \quad y(0) = 0, \quad y(1) = 0.$$

Задание 2. Найти экстремали изопериметрической задачи:

$$J[y] = \int_0^\pi [(y')^2] dx \rightarrow \min, \quad y(0) = 1, \quad y(\pi) = -1, \quad K[y] = \int_0^\pi [y \cos x] dx = \frac{\pi}{2}.$$

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

а) основная литература:

1. Васильев Ф.П. Численные методы решения экстремальных задач. М.: Наука. 1988 (215).
2. Алексеев В.М., Галеев Э.М., Тихомиров В.М. Сборник задач по оптимизации. М.: Наука. 1984 (160).

б) дополнительная литература:

1. Сухарев А.Г., Тимохов А.В., Федоров В.В. Курс методов оптимизации. М.: Наука. 1986 (4).
2. Поляк Б.Т. Введение в оптимизацию. М.: Наука. 1983 (14).

в) учебно-методическая литература, имеющаяся на кафедре прикладной математики для выдачи студентам

1. Сумин В.И. Симплекс-метод решения задач линейного программирования. Методическая разработка по курсу "Методы оптимизации". - Горький: Изд-во ГГУ, 1989 (40).
2. Чернов А.В. Применение системы MATLAB к решению простейшей задачи вариационного исчисления. Н.Новгород: ННГУ, 2007 (85).
3. Чернов А.В. Численные методы одномерной минимизации. Н.Новгород: ННГУ, 2009 (62).
4. Чернов А.В. Численные методы безусловной минимизации функций многих переменных. Н.Новгород: ННГУ, 2010 (52).
5. Чернов А.В. Численные методы условной минимизации функций многих переменных. Н.Новгород: ННГУ, 2010 (70).

г) программное обеспечение и Интернет-ресурсы:

Фонд электронных изданий ННГУ. Режим доступа:
<http://www.unn.ru/books/resources.html>

1. Сумин В.И. Начала математического программирования. Теорема Вейерштрасса. Безусловный экстремум. Электронное учебно-методическое пособие. Нижний Новгород: Нижегородский госуниверситет, 2015. – 40 с. (<http://www.unn.ru/books/resources.html>, Регистрационный номер 973.15.06).

2. Сумин В.И. Начала выпуклого анализа. Часть 1. Выпуклые множества. Электронное учебно-методическое пособие. Нижний Новгород: Нижегородский госуниверситет, 2015. – 32 с. (<http://www.unn.ru/books/resources.html>, Регистрационный номер 974.15.06).
3. Сумин В.И. Начала выпуклого анализа. Часть 2. Выпуклые функции. Электронное учебно-методическое пособие. Нижний Новгород: Нижегородский госуниверситет, 2015. – 28 с. (<http://www.unn.ru/books/resources.html>, Регистрационный номер 975.15.06).

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Помещения представляют собой учебные аудитории для проведения учебных занятий, предусмотренных программой (лекционного и семинарского типа), оснащенные оборудованием и техническими средствами обучения.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду.

Программа составлена в соответствии с требованиями ОС ННГУ 01.05.01 Фундаментальные математика и механика.

Автор (ы) к.ф.-м.н., доц. _____ А.В.Чернов

Рецензент (ы) _____

Заведующий кафедрой _____ М.В. Иванченко