

**Федеральное государственное автономное образовательное
учреждение высшего образования
«Московский физико-технический институт
(национальный исследовательский университет)»**

УТВЕРЖДЕНО
Проректор по учебной работе

А.А. Воронов

| | |
|----------------------------|---|
| | Рабочая программа дисциплины (модуля) |
| по дисциплине: | Анализ моделей и оптимизация в условиях стохастической неопределенности |
| по направлению: | Прикладные математика и физика |
| профиль подготовки: | Радиотехника и компьютерные технологии Физтех-школа Радиотехники и Компьютерных Технологий кафедра проблем передачи информации и анализа данных |
| курс: | 4 |
| квалификация: | бакалавр |

Семестр, формы промежуточной аттестации: 8 (весенний) - Дифференцированный зачет

Аудиторных часов: 30 всего, в том числе:

лекции: 15 час.

семинары: 15 час.

лабораторные занятия: 0 час.

Самостоятельная работа: 15 час.

Всего часов: 45, всего зач. ед.: 1

Программу составил: А.А. Ильин, д-р физ.-мат. наук

Программа обсуждена на заседании кафедры проблем передачи информации и анализа данных 22.05.2023

Аннотация

В данном полугодовом курсе рассматриваются три следующие основные темы.

- 1) Равномерное распределение, его моделирование, моделирование распределений случайных последовательностей, метод Монте-Карло вычисления интегралов.
- 2) Дополнительные главы выпуклой оптимизации. Метод внутренних точек. Оценки скорости его сходимости. Положительная определенность, лемма Шура. Линейные матричные неравенства. Стандартная задача полуопределенного программирования. Примеры задач, приводящих к линейным матричным неравенствам. Выпуклость функций $-\log \det A$ и $-(\det A)^{1/n}$. Экстремальные эллипсоиды: минимальный описанный эллипсоид, максимальный вписанный эллипсоид. Аналитический центр, эллипсоид Дикина. Различные неравенства выпуклости: Йенсена, Гельдера, неравенство Гёльдера для следов матриц.
- 3) Обобщенные неравенства. Конус, сопряженный конус, минимум и минимальный элемент. Метод скаляризации в многокритериальной оптимизации.

1. Цели и задачи

Цель дисциплины

Дать представление о классических и современных методах оптимизации в условиях стохастической неопределенности.

Задачи дисциплины

- моделирование случайных последовательностей и метод Монте-Карло: моделирование случайных последовательностей; критерии равномерного распределения; метод Монте-Карло для вычисления определенных интегралов и оценки сходимости;
- минимизация при наличии случайных помех: градиентный метод при наличии помех;
- дополнительные главы выпуклой оптимизации и линейные матричные неравенства: метод внутренних точек; линейные матричные неравенства; экстремальные эллипсоиды
- введение в многокритериальную оптимизацию: граница Парето; методы скаляризации.

2. Перечень формируемых компетенций

Освоение дисциплины направлено на формирование следующих компетенций:

| Код и наименование компетенции | Индикаторы достижения компетенции |
|---|--|
| ОПК-2 Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении задач профессиональной деятельности, соблюдая требования информационной безопасности | ОПК-2.2 Знает и умеет применять численные математические методы и прикладное программное обеспечение для решения научных задач в профессиональной области |
| ПК-3 Способен выбирать и применять подходящее оборудование, инструменты и методы исследований для решения задач в избранной предметной области | ПК-3.2 Знает области и критерии применимости используемых теоретических подходов и умение оценивать точность приближенных аналитических методов вычислений |
| ПК-4 Способен критически оценивать применимость используемых методик и методов | ПК-4.1 Знает численные порядки величин, характерных для соответствующей профессиональной области |

3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю)

В результате освоения дисциплины обучающиеся должны

знать:

- основы теории оптимизации и выпуклого анализа;
- основы теории статистического моделирования.

уметь:

- применять основы теории оптимизации, выпуклого анализа и статистического моделирования для решения практических задач.

владеть:

- навыком освоения большого объема информации;
- навыками постановки научно-исследовательских задач.

4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

4.1. Разделы дисциплины (модуля) и трудоемкости по видам учебных занятий

| № | Тема (раздел) дисциплины | Трудоемкость по видам учебных занятий, включая самостоятельную работу, час. | | | |
|-----------------------|--|---|----------|-----------------|----------------|
| | | Лекции | Семинары | Лаборат. работы | Самост. работа |
| 1 | Введение в многокритериальную оптимизацию. | 2 | 2 | | 2 |
| 2 | Линейные матричные неравенства и примеры задач, приводящих к ним | 4 | 4 | | 3 |
| 3 | Метод внутренних точек. | 4 | 4 | | 5 |
| 4 | Экстремальные эллипсоиды. | 5 | 5 | | 5 |
| Итого часов | | 15 | 15 | | 15 |
| Подготовка к экзамену | | 0 час. | | | |
| Общая трудоёмкость | | 45 час., 1 зач.ед. | | | |

4.2. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам)

Семестр: 8 (Весенний)

1. Введение в многокритериальную оптимизацию.

Многокритериальная оптимизация, её задача. Парето-фронт - множество Парето оптимальных значений. Задача коммивояжера и её мультиобъективизации.

2. Линейные матричные неравенства и примеры задач, приводящих к ним

Равномерное распределение, его моделирование, моделирование распределений случайных последовательностей, метод Монте-Карло вычисления интегралов.

3. Метод внутренних точек.

Дополнительные главы выпуклой оптимизации. Метод внутренних точек. Оценки скорости его сходимости. Положительная определенность, лемма Шура. Линейные матричные неравенства. Стандартная задача полуопределенного программирования Примеры задач, приводящих к линейным матричным неравенствам. Выпуклость функций $-\log \det A$ и $-(\det A)^{1/n}$. Экстремальные эллипсоиды: минимальный описанный эллипсоид, максимальный вписанный эллипсоид. Аналитический центр, эллипсоид Дикина. Различные неравенства выпуклости: Йенсена, Гельдера, неравенство Гельдера для следов матриц.

4. Экстремальные эллипсоиды.

Обобщенные неравенства. Конус, сопряженный конус, минимум и минимальный элемент. Метод скаляризации в многокритериальной оптимизации.

5. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Компьютерный класс, доска, ноутбук и мультимедийное оборудование (проектор или плазменная панель).

6. Перечень рекомендуемой литературы

Основная литература

1. Введение в оптимизацию [Текст] : [учеб. пособие для вузов] / Б. Т. Поляк .— М. : Наука, 1983 .— 384 с.

Дополнительная литература

фонд базовой кафедры

1. Лагутин М.Б. Наглядная математическая статистика. М.: Бином, 2007. – 472 с.

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины (модуля)

Не используются

8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

Программное обеспечение и информационные технологии не требуются.

9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Студент, изучающий дисциплину, должен с одной стороны, овладеть общим понятийным аппаратом, а с другой стороны, должен научиться применять теоретические знания на практике. В результате изучения дисциплины студент должен знать основные определения, понятия, аксиомы, методы доказательств.

Успешное освоение курса требует напряжённой самостоятельной работы студента. В программе курса приведено минимально необходимое время для работы студента над темой. Самостоятельная работа включает в себя:

- чтение и конспектирование рекомендованной литературы,
- проработку учебного материала (по конспектам лекций, учебной и научной литературе), подготовку ответов на вопросы, предназначенных для самостоятельного изучения, доказательство отдельных утверждений, свойств;
- подготовку к дифференцированному зачету.

Руководство и контроль за самостоятельной работой студента осуществляется в форме индивидуальных консультаций.

Важно добиться понимания изучаемого материала, а не механического его запоминания. При затруднении изучения отдельных тем, вопросов, следует обращаться за консультациями к лектору.

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

| | |
|--|---|
| по направлению: | Прикладные математика и физика |
| профиль подготовки: | Радиотехника и компьютерные технологии Физтех-школа Радиотехники и Компьютерных Технологий кафедра проблем передачи информации и анализа данных |
| курс: | 4 |
| квалификация: | бакалавр |
| Семестр, формы промежуточной аттестации: 8 (весенний) - Дифференцированный зачет | |
| Разработчик: | А.А. Ильин, д-р физ.-мат. наук |

1. Компетенции, формируемые в процессе изучения дисциплины

| Код и наименование компетенции | Индикаторы достижения компетенции |
|---|--|
| ОПК-2 Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении задач профессиональной деятельности, соблюдая требования информационной безопасности | ОПК-2.2 Знает и умеет применять численные математические методы и прикладное программное обеспечение для решения научных задач в профессиональной области |
| ПК-3 Способен выбирать и применять подходящее оборудование, инструменты и методы исследований для решения задач в избранной предметной области | ПК-3.2 Знает области и критерии применимости используемых теоретических подходов и умение оценивать точность приближенных аналитических методов вычислений |
| ПК-4 Способен критически оценивать применимость используемых методик и методов | ПК-4.1 Знает численные порядки величин, характерных для соответствующей профессиональной области |

2. Показатели оценивания компетенций

В результате изучения дисциплины «Анализ моделей и оптимизация в условиях стохастической неопределенности» обучающийся должен:

знать:

- основы теории оптимизации и выпуклого анализа;
- основы теории статистического моделирования.

уметь:

- применять основы теории оптимизации, выпуклого анализа и статистического моделирования для решения практических задач.

владеть:

- навыком освоения большого объема информации;
- навыками постановки научно-исследовательских задач.

3. Перечень типовых (примерных) вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю

С целью контроля освоения обучающимися учебного материала проводится устный опрос в начале занятия по теме прошлой лекции или в конце занятия по пройденной теме.

4. Перечень типовых (примерных) вопросов и тем для проведения промежуточной аттестации обучающихся

1. Равномерное распределение и его моделирование.
2. Метод Монте-Карло.
3. Сходимость градиентного метода при наличии помех.
4. Метод внутренних точек в выпуклой оптимизации.
5. Метод внутренних точек, скорость его сходимости.
6. Положительная определенность, лемма Шура.
7. Стандартная задача полуопределенного программирования.
8. Линейные матричные неравенства.
9. Примеры задач, приводящих к линейным матричным неравенствам.
10. Экстремальные эллипсоиды.
11. Фронт Парето.
12. Метод скаляризации в многокритериальной оптимизации.

Критерии оценивания

Оценка отлично 10 баллов - выставляется студенту, показавшему всесторонние, систематизированные, глубокие знания учебной программы дисциплины, проявляющему интерес к данной предметной области, продемонстрировавшему умение уверенно и творчески применять их на практике при решении конкретных задач, свободное и правильное обоснование принятых решений.

Оценка отлично 9 баллов - выставляется студенту, показавшему всесторонние, систематизированные, глубокие знания учебной программы дисциплины и умение уверенно применять их на практике при решении конкретных задач, свободное и правильное обоснование принятых решений.

Оценка отлично 8 баллов - выставляется студенту, показавшему всесторонние, систематизированные, глубокие знания учебной программы дисциплины и умение уверенно применять их на практике при решении конкретных задач, правильное обоснование принятых решений, с некоторыми недочетами.

Оценка хорошо 7 баллов - выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, умеет применять полученные знания на практике, но недостаточно грамотно обосновывает полученные результаты.

Оценка хорошо 6 баллов - выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, умеет применять полученные знания на практике, но допускает в ответе или в решении задач некоторые неточности.

Оценка хорошо 5 баллов - выставляется студенту, если он в основном знает материал, грамотно и по существу излагает его, умеет применять полученные знания на практике, но допускает в ответе или в решении задач достаточно большое количество неточностей.

Оценка удовлетворительно 4 балла - выставляется студенту, показавшему фрагментарный, разрозненный характер знаний, недостаточно правильные формулировки базовых понятий, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, но при этом он освоил основные разделы учебной программы, необходимые для дальнейшего обучения, и может применять полученные знания по образцу в стандартной ситуации.

Оценка удовлетворительно 3 балла - выставляется студенту, показавшему фрагментарный, разрозненный характер знаний, допускающему ошибки в формулировках базовых понятий, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, слабо владеет основными разделами учебной программы, необходимыми для дальнейшего обучения и с трудом применяет полученные знания даже в стандартной ситуации.

Оценка неудовлетворительно 2 балла - выставляется студенту, который не знает большей части основного содержания учебной программы дисциплины, допускает грубые ошибки в формулировках основных принципов и не умеет использовать полученные знания при решении типовых задач.

Оценка неудовлетворительно 1 балл - выставляется студенту, который не знает основного содержания учебной программы дисциплины, допускает грубейшие ошибки в формулировках базовых понятий дисциплины и вообще не имеет навыков решения типовых практических задач.

5. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

Во время проведения дифференцированного зачета обучающиеся могут пользоваться программой дисциплины, а также справочной литературой, вычислительной техникой, конспектами лекций.

Дифференцированный зачет может проводиться по итогам текущей успеваемости и сдачи заданий, или путем организации специального опроса, проводимого в устной форме.