

توضیحات: حل تمرین دارد	نام انگلیسی درس:	نام درس: بهینه‌سازی خطی ۱
	Linear Optimization I	تعداد واحد: ۳
	پیش‌نیاز: جبر خطی برای آمار و آنالیز ریاضی ۱	تعداد ساعت:
	فعالیت کلاسی:	نوع درس: اختیاری نوع واحد: نظری



**هدف کلی درس:**

آشنایی با بهینه‌سازی خطی در فضاهای متناهی البعد، شامل: مدل‌سازی و کاربردهای آن، حل مدل‌ها، دوگان، تفسیرهای هندسی، جبری و اقتصادی و درک برخی کاربردهای آنالیز و جبر خطی در دیگر شاخه‌های ریاضیات و درک ارتباط‌های بین ریاضیات، اقتصاد و صنعت

**سرفصل مطالب:**

- مقدمه‌ای بر بهینه‌سازی، انواع مسائل بهینه‌سازی، اهمیت و کاربرد آن‌ها مدل‌سازی: چگونگی تبدیل مسائل واقعی به مسائل بهینه‌سازی ریاضی، حل هندسی مسائل بهینه‌سازی خطی (LP)
- پوسته خطی، پوسته محدب و پوسته آفین و ارتباط آن‌ها با LP ها مفهوم بعد، مجموعه‌های محدب، چند وجهی‌ها، ابر صفحه‌ها، نیم فضا، اشعه، توابع محدب و خواص و اهمیت آن‌ها در بهینه‌سازی خطی، مفهوم و خواص نقاط راسی و جهت‌های دور شونده (راسی) چندوجهی‌ها و نحوه به دست آوردن آن‌ها،
- قضیه نمایش و کاربردهای آن، شرایط لازم و کافی وجود جواب بهینه (نتایج قضیه نمایش)،
- الگوریتم سیمپلکس: معیارهای بهینگی، بی‌کراتگی، وارد شونده‌گی و خارج شونده‌گی متغیرها، حل مثال‌های عددی با الگوریتم سیمپلکس (به صورت دستی و برنامه‌نویسی)، تفسیر الگوریتم سیمپلکس از سه دیدگاه جبری، هندسی و اقتصادی، وجود جواب‌های بهینه دگرین و نحوه به دست آوردن آن‌ها، تباهیدگی، همگرایی الگوریتم سیمپلکس در غیاب تباهیدگی،
- قضیه نمایش برای مجموعه جواب‌های بهینه دگرین، متغیرهای مصنوعی و استفاده از روش M-بزرگ (روش دوفازی، در صورت وجود زمان کافی)، قضایای دگرین: لم فارکاس و قضیه گردن، شرایط بهینگی KKT (اثبات قضیه KKT و تعبیر هندسی آن)،
- مفهوم دوگان، طریقه نوشتن دوگان یک LP، قضایای دوگان: ضعیف، قوی، قضیه مکمل زائد ضعیف،
- قضیه اساسی دوگانی، قضیه مکمل زائد قوی، کاربردهای دوگان و شرایط مکمل زائد ضعیف، روش سیمپلکس دوگان، محاسبه جواب‌های بهینه دوگان از روی جواب بهینه اولیه، تحلیل حساسیت، تعبیر اقتصادی دوگان و جواب‌های بهینه دوگان، قیمت‌های سایه‌ای،
- حل دستگاه‌ها و ارتباط آن با بهینه‌سازی خطی، ارتباط بین تباهیدگی و دگرینگی اولیه و دوگان، پایداری و استواری
- نکته: هدف اصلی از ارائه این درس در محتوای ریاضی آن نهفته است، و لذا توصیه می‌شود مدرس به هیچ وجه از محتوای نظری آن شامل اثبات‌های ریاضی و ارائه مفاهیم دقیق و بنیادی این شاخه کم ننماید.

فهرست منابع:

- 1- Bazaraa, M. S. Jarvis, J. J. and Sherali, H. D. *Linear Programming and Network Flows*, 2<sup>nd</sup>, Wiley, 2006.
- 2- Bertsimas, D. and Tsitsiklis, J. N. *Introduction to Linear Optimization*, Athena Scientific, 1997.
- 3- Ferris, M. C. Mangasarian. O. L. and Wright. S. J. *Linear Programming with MATLAB*, SIAM, 2008.



روش ارزشیابی:

ارزشیابی مستمر	میان‌ترم	آزمون‌های نهایی	پروژه
		نوشتاری:	
		عملکردی:	---