



Programa de Fundamentos de Optimización

1. NOMBRE DE LA UNIDAD CURRICULAR

Fundamentos de Optimización

2. CRÉDITOS

6 créditos

3. OBJETIVOS DE LA UNIDAD CURRICULAR

Se espera que el estudiante sea capaz de reconocer y plantear problemas de optimización, y realizar modelados sencillos en forma de problemas de optimización.

Además, será capaz de reconocer la dificultad de problemas de optimización, de proponer distintas familias de métodos acorde al problema y su naturaleza, y conocer las garantías o debilidades de dichos métodos.

4. METODOLOGÍA DE ENSEÑANZA

Dos clases teóricas semanales de una hora y media, más una clase semanal de práctico de igual duración. En estas últimas, se combinarán ejercicios con prácticas en computadora.

5. TEMARIO

1. Introducción: Descripción general de los problemas a tratar en el curso. Repaso de algunos conceptos de cálculo y álgebra lineal. Derivación de funciones matriciales.
2. Optimización en una variable: Primeros conceptos de optimización, utilizando ejemplos de una variable. Método de Golden-section.
3. Convexidad: Funciones y conjuntos convexos.
4. Optimización sin restricciones. Condiciones de optimalidad, y métodos iterativos. Descenso por gradiente, Nesterov, y variantes. Método de gradiente conjugado. Coordinate descent.
5. Optimización con restricciones: Métodos de gradiente proyectado. Conceptos básicos de Teoría de Lagrange, y algoritmos resultantes.
6. Otros tópicos: Minimización alternada. Subgradientes.
7. Paquetes de software: Ejemplos de uso de paquetes de software de optimización (CVX, JuMP, etc).

6. BIBLIOGRAFÍA

Identificación de las publicaciones básicas y complementarias adecuadas para el buen seguimiento del curso. Se debería observar la disponibilidad de estos textos, tanto en la Biblioteca de Facultad como en el mercado. En caso de existir varios textos principales, indicar para qué tema aporta cada uno. La referencia bibliográfica deberá darse de la siguiente forma:

Tema	Básica	Complementaria
Introducción	(2)	(5)
Optimización en una variable	(1),(2)	(5)
Convexidad	(2)	(5)
Optimización sin restricciones	(1),(2), (4)	(5)
Optimización con restricciones	(1),(2)	(5)
Otros tópicos	(4)	
Paquetes de software		

6.1 Básica

1. Dimitri P. Bertsekas. Nonlinear Programming
2. Stephen Boyd and Lieven Vandenberghe, Convex Optimization.
3. Nesterov, Yurii (2003). Introductory Lectures on Convex Optimization: A Basic Course. Springer.
4. Stephen J. Wright. Coordinate Descent Algorithms (notas)

6.2 Complementaria

5. Jorge Nocedal and Stephen Wright, Numerical Optimization

7. CONOCIMIENTOS PREVIOS EXIGIDOS Y RECOMENDADOS

7.1 Conocimientos Previos Exigidos: Conocimientos sólidos en cálculo en una y varias variables, y en álgebra lineal.

7.2 Conocimientos Previos Recomendados: Conocimientos básicos de análisis numérico, ecuaciones diferenciales, y programación.

ANEXO A

Para todas las Carreras

Esta primera parte del anexo incluye aspectos complementarios que son generales de la unidad curricular.

A1) INSTITUTO

IMERL

A2) CRONOGRAMA TENTATIVO

Consiste en un cronograma de avance semanal con detalle de las horas de clase asignadas a cada tema.

Semana 1	Introducción (1.5 hs de clase). Optimización en una variable (1.5 hs de clase).
Semana 2	Convexidad (3 hs de clase).
Semana 3	Optimización sin restricciones: Condiciones de optimalidad, y métodos iterativos. Descenso por gradiente. (3 hs de clase).
Semana 4	Optimización sin restricciones: Nesterov y variantes. Método de gradiente conjugado. Coordinate descent. (3 hs de clase).
Semana 5	Optimización con restricciones: Métodos de gradiente proyectado. (3 hs de clase).
Semana 6	Optimización con restricciones: Conceptos básicos de Teoría de Lagrange. (3 hs de clase).
Semana 7	Otros tópicos (1.5 hs de clase). Paquetes de software (1.5 hs de clase).
Semana 8	
Semana 9	
Semana 10	
Semana 11	
Semana 12	
Semana 13	
Semana 14	
Semana 15	

A3) MODALIDAD DEL CURSO Y PROCEDIMIENTO DE EVALUACIÓN

La evaluación consistirá en entrega de ejercicios durante el curso, y, en función de la cantidad de estudiantes inscriptos, un proyecto final o un examen final.

A4) CALIDAD DE LIBRE

Debido a la forma de evaluación, no corresponde la calidad de libre.

A5) CUPOS DE LA UNIDAD CURRICULAR

(En caso de que corresponda, indicar los cupos totales.)

Cupos mínimos:

Cupos máximos:

Nota:

Si se definen cupos, en una nota aparte se deberá incluir:

- *motivo por el cual la unidad curricular tiene cupos (tanto máximos como mínimos).*
- *el mecanismo de selección para cuando se dé la situación de que la cantidad de estudiantes inscriptos supere el cupo máximo.*