

**Module Description, available in: EN, FR**

# Optimization

## General Information

**Number of ECTS Credits**

3

**Module code**

FTP\_Optimiz

**Valid for academic year**

2019-2020

**Last modification**

2018-11-05

**Responsible of module**

Andreas Klinkert (ZHAW, andreas.klinkert@zhaw.ch)

**Explanations regarding the language definitions for each location:**

- Instruction is given in the language defined below for each location/each time the module is held.
- Documentation is available in the languages defined below. Where documents are in several languages, the percentage distribution is shown (100% = all the documentation).
- The examination is available 100% in the languages shown for each location/each time it is held.

	Berne	Lausanne	Lugano	Zurich
<b>Instruction</b>		X F 100%		X E 100%
<b>Documentation</b>		X F 100%		X E 100%
<b>Examination</b>		X F 100%		X E 100%

**Module Category**

FTP Fundamental theoretical principles

**Lessons**

2 lecture periods and 1 tutorial period per week

## Entry level competences

**Prerequisites, previous knowledge**

Linear algebra:

- Systems of linear equations, Gauss algorithm
- Basics of vector and matrix algebra, linear spaces

Analysis:

- Calculus with functions of one variable
- Zeros of functions (Newton algorithm)

Programming:

- Basics of procedural programming and ability to implement small programs in an arbitrary language, e.g. Python, Matlab, R, Java, C#, C++, C, etc.

## Brief course description of module objectives and content

This course offers an introduction to optimization, emphasizing basic methodologies and underlying mathematical structures. Optimization refers to the application of mathematical models and algorithms to decision making. A large number of quantitative real-world problems can be formulated and solved in this general framework. Applications of optimization comprise, for instance, decision problems in production planning, supply chain management, transportation networks, machine and workforce scheduling, blending of components, telecommunication network design, airline fleet assignment, and revenue management.

## Aims, content, methods

### Learning objectives and acquired competencies

- The student has an overview of the various fields and approaches to optimization.
- The student has a basic mathematical and algorithmic understanding of the major optimization methods used in practice (Linear Programming (LP), Integer Programming (ILP), Nonlinear Programming, Optimization in Graphs, Metaheuristics).
- The student is able to analyze basic real-world decision problems and formulate appropriate optimization models.
- The student is able to implement and solve basic LP/ILP models in a spreadsheet.
- The student has developed a certain intuition on how to approach and analyze real-world optimization problems, to correctly estimate their complexity, and to choose appropriate modeling approaches and implementation tools.

### Contents of module with emphasis on teaching content

Week	Topics
1	<b>PART 1:</b>
2	<b>Introduction to Optimization</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Basic concepts: models, variables, parameters, constraints, objective, optima</li> <li>• Examples of problems and models of different types: linear/nonlinear, discrete/continuous, deterministic/stochastic constrained/unconstrained</li> <li>• Solution methods: exact algorithms, constructive heuristics, improvement heuristics</li> <li>• Global vs. local optima, basic ideas of convex optimization</li> </ul>
3	<b>Linear Programming</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Mathematical formulation and terminology, canonical and standard form, transformations</li> <li>• Geometry: linear inequalities, polyhedra, graphical representation, examples</li> <li>• Simplex algorithm</li> </ul>
4	
5	
6	<b>Integer Programming</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Basic concepts</li> <li>• Branch-and-Bound method</li> <li>• Cutting Planes method</li> <li>• Various applications and modeling techniques</li> </ul>
7	
8	<b>PART 2:</b> <b>Nonlinear Optimization</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Unconstrained multidimensional optimization: optimality conditions, Gradient- and Newton-methods</li> </ul>
9	<b>Graphs and Networks</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Optimization in graphs</li> <li>• Paths and cycles</li> <li>• Network flows</li> <li>• Selected combinatorial optimization problems</li> </ul>
10	
11	
12	<b>Heuristics and Metaheuristics</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Trajectory-based methods: hill climbing, tabu search, simulated annealing, ...</li> <li>• Population-based methods: evolutionary algorithms, ant colony optimization, ...</li> </ul>
13	
14	

### Teaching and learning methods

Lectures and exercises

### Literature

## Assessment

### Certification requirements

Module does not use certification requirements

### Basic principle for exams

**As a rule, all the standard final exams for modules and also all repetition exams are to be in written form**

### Standard final exam for a module and written repetition exam

#### Kind of exam

written

#### Duration of exam

120 minutes

#### Permissible aids

*Aids permitted as specified below:*

#### Permissible electronic aids

None.

In particular: Pocket calculators are not allowed.

#### Other permissible aids

Exam "open book": Any written documents are allowed.

### Special case: Repetition exam as oral exam

#### Kind of exam

oral

#### Duration of exam

30 minutes

#### Permissible aids

No aids permitted

**Description du module, disponible en: EN, FR**

## Optimisation

### Informations générales

Nombre de crédits ECTS

3

Code du module

FTP\_Optimiz

Valable pour l'année académique

2019-2020

Dernière modification

2018-11-05

Nom du/de la responsable de module

Andreas Klinkert (ZHAW, andreas.klinkert@zhaw.ch)

Explication des définitions de langue par lieu :

- Les cours se dérouleront dans la langue définie ci-dessous par lieu/exécution.
- Les documents sont disponibles dans les langues définies ci-dessous. Pour le multilinguisme, voir la répartition en pourcentage (100% = documents complets)
- L'examen est disponible à 100% dans chaque langue sélectionnée pour chaque lieu/exécution.

	Berne	Lausanne	Lugano	Zurich
<b>Leçons</b>		X F 100%		X E 100%
<b>Documentation</b>		X F 100%		X E 100%
<b>Examen</b>		X F 100%		X E 100%

Catégorie de module

FTP bases théoriques élargies

Leçons

2 leçons et 1 leçon de pratique par semaine

### Compétences préalables

Connaissances préalables, compétences initiales

Algèbre linéaire:

- Systèmes d'équations linéaires, algorithme de Gauss
- Calcul vectoriel et matriciel de base, espaces linéaires

Analyse:

- Calcul différentiel avec des fonctions à une variable
- Recherches de zéros (algorithme de Newton)

Programmation:

- Concepts de bases de la programmation procédurale et la capacité de formuler des petits programmes dans un langage quelconque, par exemple Python, Matlab, R, Java, C#, C++, C, etc.

## Brève description du contenu et des objectifs

Ce cours offre une introduction à l'optimisation, en mettant l'accent sur les méthodologies de base et les structures mathématiques sous-jacentes. L'optimisation fait référence à l'application de techniques et de méthodes mathématiques aux problèmes de prise de décision. Un grand nombre de problèmes quantitatifs réels peuvent être modélisés et résolus dans cette structure générale. Planification de production, supply chain management, réseaux de transport, ordonnancement de machines et de personnel, design de réseaux de télécommunication, airline fleet assignment, et revenue management sont des exemples d'applications parmi d'autres.

## Objectifs, contenus, méthodes

### Objectifs d'apprentissage, compétences à acquérir

- L'étudiant a une vue d'ensemble des différents domaines et des différentes approches d'optimisation.
- L'étudiant comprend les bases mathématiques et algorithmiques des principales méthodes d'optimisation utilisées dans la pratique (Linear Programming (LP), Integer Programming (ILP), Nonlinear Programming, optimisation dans les graphes, métaheuristiques).
- L'étudiant est capable d'analyser des problèmes simples de prise de décision réels et de formuler des modèles d'optimisation appropriés.
- L'étudiant est capable de mettre en place et de résoudre des modèles LP/ILP de base à l'aide d'un tableur.
- L'étudiant a développé une certaine intuition lui permettant d'aborder et d'analyser des problèmes réels, d'estimer leur complexité et de choisir une approche de modélisation et les outils d'implémentation appropriés.

### Contenu des modules avec pondération du contenu des cours

Semaine	Sujets
1	<b>PARTIE 1:</b>
2	<b>Introduction à l'optimisation</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Idées de base: modèles, variables, paramètres, contraintes, objectifs, optima</li> <li>• Exemples de problèmes et de modèles de différents types: linéaires/non linéaires, discrets/continus, déterministes/stochastiques, avec contraintes/sans contraintes</li> <li>• Méthodes de résolution: algorithmes exactes, heuristiques constructives, heuristiques d'amélioration</li> <li>• Optima globaux vs. locaux, concepts de base de l'optimisation convexe</li> </ul>
3	<b>Programmation linéaire</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Formulation mathématique et terminologie, forme canonique et standard, transformations</li> <li>• Géométrie: inéquation linéaires, polyèdres, représentation graphique, exemples</li> <li>• Algorithme du simplexe</li> </ul>
4	
5	
6	<b>Programmation linéaire entière</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Concepts de base</li> <li>• Méthode Branch-and-Bound</li> <li>• Méthode Cutting Planes</li> <li>• Applications et techniques de modélisation diverses</li> </ul>
7	
8	<b>PARTIE 2:</b>
	<b>Optimisation non linéaire</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Optimisation multidimensionnelle sans contraintes: conditions d'optimalité, algorithme de gradient et algorithme de...</li> </ul>
9	<b>Graphes et réseaux</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Optimisation dans les graphes</li> <li>• Cycles et chemins</li> <li>• Flots de réseau</li> <li>• Problèmes sélectionnés d'optimisation combinatoire</li> </ul>
10	
11	
12	<b>Heuristiques et métaheuristiques</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Méthodes de trajectoire: grimpeur, recherche tabou, recuit simulé, ...</li> <li>• Méthodes basées sur une population: algorithmes évolutionnistes, colonies de fourmis, ...</li> </ul>
13	
14	

### Méthodes d'enseignement et d'apprentissage

Cours magistral et travaux dirigés

### Bibliographie



## Evaluation

### Conditions d'admission

Le module n'utilise pas de conditions d'admission.

### Principe pour les examens

**En règle générale, tous les examens de fin de module réguliers et les examens de rattrapage sont organisés sous la forme écrite**

### Examen de fin de module régulier et examen écrit de répétition

#### Type de l'examen

écrit

#### Durée de l'examen

120 minutes

#### Aides autorisés

*Les aides suivantes sont autorisées:*

#### Aides électroniques autorisées

Aucun.

Notamment: Les calculatrices ne sont pas autorisées.

#### Autres aides autorisées

Examen "à livre ouvert" ("open book"): Tous les moyens écrits sont autorisés.

### Cas spécial: examen de répétition oral

#### Type de l'examen

oral

#### Durée de l'examen

30 minutes

#### Aides autorisés

Sans aides