

CheatSheet di Ricerca Operativa e Pianificazione delle Risorse

Fabio Ferrario

@fefabo

2022/2023

Indice

1	Ottimizzazione Non Lineare	3
1.1	Algoritmo del Gradiente	3
2	Ottimizzazione Non Lineare Vincolata	4
2.1	Condizioni di KKT	4

Capitolo 1

Ottimizzazione Non Lineare

1.1 Algoritmo del Gradiente

Data una funzione a più variabili $f(X)$ e un punto x^0 , ogni passo del metodo del gradiente si effettua in questo modo:

1. Calcolo $\nabla f(x^k)$, con la direzione di crescita $d^k = \pm \nabla f(x^k)$ (+ max e - min)
2. Calcolo $x^{k+1} = x^k \pm \alpha^k \cdot d^k$
3. In cui α^k è il max di $f(x^k \pm \alpha^k \cdot d^k)$. ovvero Valuto f nel nuovo punto e massimizzo la funzione risultante $g(\alpha)$, generalmente in modo analitico ($g'(\alpha) = 0$).
4. Sostituisco α trovato in x^{k+1} .
5. Valuto i criteri di arresto (Con epsilon o con un numero predefinito di iterazioni, e nel caso ripeto)

Per verificare che il punto trovato sia un punto di ottimo, semplicemente controllo che $\nabla f(x^*) = 0$.

Capitolo 2

Ottimizzazione Non Lineare Vincolata

2.1 Condizioni di KKT

In un problema di ottimizzazione vincolata definito come:

$$\begin{aligned} & \text{opt } f(x_1, \dots, x_n), \\ & g_m(x_1, \dots, x_n) = 0 \text{ Vincoli di Uguaglianza,} \\ & h_l(x_1, \dots, x_n) \leq 0 \text{ Vincoli di Disuguaglianza,} \end{aligned}$$

Generiamo la Lagrangiana cosí definita:

$$L(V) = f(X) \pm \sum_{i=0}^m \lambda_i \cdot g_i(X) \pm \sum_{j=0}^l \mu_j \cdot h_j(X) \text{ Per i problemi di MIN}$$

in cui \pm diventa $+$ per i problemi di MIN e $-$ per i problemi di MAX, Abbiamo che λ sono i moltiplicatori lagrangiani associati ai vincoli di Uguaglianza, e μ quelli associati ai vincoli di Disuguaglianza.

con $V = \{x_1, \dots, x_n, \lambda_1, \dots, \lambda_m, \mu_1, \dots, \mu_l\}$, ovvero tutte le variabili e $X = \{x_1, \dots, x_n\}$, ovvero tutte le variabili originali.

La tabella e il sistema Avendo questo, bisogna quindi generare un sistema che avrà $n+m+l$ incognite utilizzando le KKT, riportate qui in modo semplificato:

Stazionarietà Problemi di MIN (-)		
$\nabla f = - \sum \lambda_i \cdot \nabla g_i - \sum \mu_j \cdot \nabla h_j$		
Stazionarietà Problemi di MAX (+)		
$\nabla f = + \sum \lambda_i \cdot \nabla g_i + \sum \mu_j \cdot \nabla h_j$		
Ammissibilità Vincoli Uguaglianza	\forall	$g_i = 0$
Ammissibilità Vincoli Disuguaglianza	\forall	$h_j \leq 0$
Condizione di Complementarietà	\forall	$\mu_j \cdot h_j = 0$
Non Negatività di μ	\forall	$\mu_j \geq 0$

Dove con \forall si intende chiaramente tutti quelli presenti.