

Optimisation

ECTS : 6

Description du contenu de l'enseignement :

Optimisation dans R^n (cas général et cas convexe).

Optimisation sous contrainte d'égalité, d'inégalité.

KKT, cas convexe, lemme de Farkas, dualité.

Techniques de programmation dynamique : programmation dynamique en temps discret (problèmes en horizon fini ; problèmes en horizon infini avec coût escompté),

Introduction à la théorie du contrôle optimal (principe de Pontriaguine, équation de Hamilton-Jacobi-Bellman).

Enseignant responsable : PIERRE CARDALIAGUET

Compétence à acquérir :

L'objectif de ce cours est, d'une part, de reprendre l'optimisation dans R^n et, d'autre part, d'étudier les techniques de programmation dynamique déterministe qui sont fondamentales dans les applications.

Document susceptible de mise à jour - 06/02/2026

Université Paris Dauphine - PSL - Place du Maréchal de Lattre de Tassigny - 75775 PARIS Cedex 16