

US331N - Mise à niveau

Présentation

Prérequis

Aucun

Objectifs pédagogiques

Etre capable de suivre les cours du master MPRO (M2)

Programme

Contenu

Complexité des algorithmes :

- Définition d'un algorithme, évaluation des algorithmes, complexité des algorithmes.

Probabilités et chaînes de Markov

- *Séance 1* : Probabilité d'une expérience aléatoire, dénombrement, variables aléatoires.
- *Séance 2* : Processus aléatoires (markoviens, stationnaires, poisson, naissance, naissance et mort), les chaînes de Markov (Définition, matrice associée à une chaîne de Markov, matrice stochastique, graphe associé à une chaîne de Markov, distribution limite dans une chaîne de Markov).

Graphes

- *Séance 1* : (Notions de base – Arbres)
Graphes orienté et non orienté, représentations matricielles, sous-graphe, graphe partiel, graphe complet, clique, stable.
- *Séance 2* : (Problèmes de plus courts chemins)
Algorithmes de plus courts chemins: Moore- Dijkstra, Bellman-Ford et Bellman.
- *Séance 3* : (Flots dans les réseaux)
Problème de transport, propriétés des coupes dans un graphe, graphe d'écart, algorithme de Ford & Fulkerson, extensions.

Programmation linéaire

- *Séance 1* : rappels sur la forme générale d'un PL, les égalités linéaires, convexité et solutions de base, caractérisation des bases et solutions de base optimales, changement de bases, algorithme du simplexe.
- *Séance 2* : problèmes soulevés par la dégénérescence, initialisation de l'algorithme du simplexe (résolution en 2 phases avec la méthode des variables artificielles), notion de dualité.

Méthode de séparation et d'évaluation et programmation dynamique

- *Séance 1* : Procédures Branch & Bound : généralités et définitions, concepts de séparation et d'évaluation, algorithme de séparation et évaluation, illustration sur le problème du sac à dos.
- *Séance 2* : Programmation dynamique déterministe illustrée sur le problème du sac à dos.

Modèles stochastiques

Mis à jour le 12-02-2024



Code : US331N

Unité spécifique de type cours

0 crédits

Responsabilité nationale :

EPN05 - Informatique / 1

Contact national :

Recherche opérationnelle

2D4P20, 33-1-10, 2 rue Conté

75003 Paris

01 40 27 22 67

secretariat.ro@cnam.fr

- *Partie 1* : Espérance conditionnelle d'un couple de variables aléatoires (espace de probabilités, variables aléatoires, couple de variables aléatoires – cas discret.
- *Partie 2* : Optimisation continue : optimisation sans contraintes, optimisation sous contraintes d'égalité et d'inégalité, conditions d'optimalité.

Modalités de validation

- Contrôle continu