

CURS ACADÈMIC: 2004 – 2005
ENSENYAMENT: ADMINISTRACIÓ I DIRECCIÓ D'EMPRESES

ASSIGNATURA: INVESTIGACIÓ OPERATIVA

PROFESSOR/A: SILVIA MIQUEL FERNANDEZ

CURS: PRIMER/SEGON CRÈDITS: 6 TIPUS: OPTATIVA

1. OBJECTIUS

- Assolir les bases matemàtiques necessàries per resoldre problemes de programació lineal contínua, programació sencera i programació multiobjectiu.
- Conèixer algunes aplicacions de la programació lineal en l'economia i l'empresa.
- Plantejar i reconèixer correctament qualsevol problema de programació lineal, determinar el mètode de resolució i saber utilitzar les eines informàtiques adients.
- Conèixer certes aplicacions de la Teoria de Jocs.

2. CONTINGUTS

En una primera part de l'assignatura es presenta el plantejament d'un programa lineal i els possibles mètodes de resolució. Seguidament es considera i justifica el simplex com a mètode que ens permet trobar la solució d'un programa lineal. Posteriorment s'analitzen problemes inicialment plantejats i resolts. Aquest cop es tracta d'observar les conseqüències que tindrien certs canvis produïts en el plantejament inicial, sobre la solució prèviament obtinguda.

A continuació, ens fixem en situacions que donen lloc a programes sencers i multiobjectiu.

Finalment es realitza una introducció a la Teoria de Jocs i les solucions que aquesta proposa.

3. PROGRAMA

1. Programació lineal.
 - 1.1. Definició del programa lineal.
 - 1.2. Característiques dels programes lineals.
 - 1.3. Aproximació intuïtiva al mètode de resolució dels programes lineals.
2. L'algoritme del simplex.
 - 2.1. L'algoritme del simplex.
 - 2.2. Expressió matricial de l'algoritme del simplex.
 - 2.3. L'algoritme del simplex-dual.
3. Interpretació dels resultats.
 - 3.1. Activació d'una variable de decisió secundària.
 - 3.2. Increment del terme independent d'una restricció.
 - 3.3. Situacions especials: solució no limitada, solució múltiple i inexistència de solució.

4. Anàlisi post-òptim.
 - 4.1. Modificació dels coeficients tècnics de les restriccions.
 - 4.2. Addició d'una restricció.
5. Anàlisi de la sensibilitat.
 - 5.1. Modificació d'un coeficient de la funció objectiu.
 - 5.2. Modificació del terme independent d'una restricció.
6. Anàlisi paramètric.
 - 6.1. Parametrització de la funció objectiu.
 - 6.2. Parametrització dels termes independents.
7. El model dual.
 - 7.1. Teoremes fonamentals.
 - 7.2. Duals de plantejaments no simètrics.
8. Programació lineal sencera i multiobjectiu.
 - 8.1. Introducció a la programació sencera.
 - 8.2. Els mètodes d'aproximació i enumeració explícita.
 - 8.3. L'algoritme branch and bound.
 - 8.4. Introducció a la programació 0-1.
 - 8.5. Introducció a la programació multiobjectiu. Solucions eficients i de millor compromís.
 - 8.6. El mètode de les ponderacions i el simplex multiobjectiu.
9. Teoria de Jocs.
 - 9.1. Jocs no cooperatius.
 - 9.2. Jocs cooperatius.

4. MATERIALS DE L'ASSIGNATURA

- Pràctiques disponibles al servei de còpisteria.
- Software disponible a l'aula d'informàtica de la Facultat de Dret i Economia: QSB.

5. BIBLIOGRAFIA

Bibliografia bàsica:

Sydsaeter K. i Hammond, P. (1996) *Matemáticas para el análisis*. Prentice Hall .
 Ríos Insua, S. (1996) *Investigación operativa. Programación lineal i aplicaciones*. Ed. CERA.

Bibliografia complementària:

Chiang, A. (1987) *Métodos fundamentales de la economía matemática*. McGraw-Hill.
 Gardner, R. (1992) *Juegos para empresarios y economistas*. Antoni Bosch Editor.
 Heras et al. (1990) *Programación matemática y modelos económicos: Un enfoque teórico-práctico*. AC.
 Rafels, C. et al. (1999) *Jocs cooperatius i aplicacions econòmiques*. Ediciones UB.
 Ramos, E. (1995) *Programación lineal y métodos de optimización*. UNED.
 Taha, H.A. (1991) *Investigación de operaciones*. Alfaomega.
 Villalba, D, i Jerez, M. (1990) *Sistemas de optimización para la planificación y toma de decisiones*. Pirámide.
 Winston, W. (1991) *Investigación de operaciones*. Grupo editorial Iberoamérica.

6. AVALUACIÓ

El 70% de la qualificació ve determinat per un examen teòric i pràctic escrit.
 El 30% restant ve determinat per un examen pràctic resolt a l'aula d'informàtica amb la disponibilitat del QSB.

Nota: En la convocatòria de setembre el 100% de la qualificació ve determinat per un examen escrit. No es disposarà del QSB per la seva resolució.