
ROBERT B GRAMACY, University of Chicago

Optimisation dans le cadre de contraintes inconnues

Nous considérons l'optimisation pour des expériences informatiques dans le cadre de contraintes inconnues, c'est-à-dire lorsqu'une simulation est requise afin de déterminer les réponses de valeurs réelles et vérifier les contraintes. Nous développons des processus gaussien substitués pour approximer les deux sorties du simulateur. Un nouveau critère intégré d'amélioration établit que les réponses qui ne respectent pas la contrainte permettent quand même d'en apprendre sur la fonction, et sont ainsi potentiellement utiles pour l'optimisation. Nous illustrons notre approche à l'aide d'un problème dans la politique des soins de santé.