

1781

CONTEXTO; Entrega N° 1.560; Julio 1, 2019

PHILIP STARR WOLFE

(1927 - 2016)

Nació en San Francisco, Estados Unidos.

Estudió en la Universidad de California, Berkeley.

Trabajó en el departamento de matemáticas de la Universidad Princeton.

Enseñó en la Universidad Columbia y en el Instituto Politécnico de Nueva York.

En 1992, con su amigo Alan Hoffman, compartió el premio John von Neumann.

En 1993 R. W. Cottle y D. Colfarb publicaron un libro de ensayos en su honor.

¿Por qué los economistas nos acordamos de Wolfe? Porque “fue uno de los padres fundadores de la programación matemática” (Crowder, 2016).

“Mientras cursaba el doctorado, leyendo un artículo de ciencia-ficción se enteró de la existencia de la teoría de los juegos. A raíz de lo cual entró en contacto con George Dantzig, quien lo desafió a resolver un problema que enfrentaba quien utilizaba el método simplex para computar la solución de los problemas de programación lineal” (NN, 2016). “Le sugirió a Dantzig cómo eludir una trampa para evitar que el método no pudiera converger a la posición óptima” (Crowder, 2016).

“En Princeton se concentró en programación cuadrática, es decir, la maximización o minimización de una función cuadrática, sujeta a restricciones. Con Marguerite Frank publicó un trabajo contemporáneo con el elaborado por Harry Max Markowitz, sobre selección de portafolios vía minimización cuadrática parametrizada” (NN, 2016). “El astuto editor del Naval research logistics quarterly le envió cada manuscrito al otro, para la correspondiente labor de referato, publicándolos a ambos en el mismo número de la revista, en 1956” (Crowder, 2016).

“En RAND trabajó con Dantzig, Ray Fulkerson y Lloyd Shapley, para mejorar el algoritmo simplex. Con Dantzig desarrolló el método de descomposición, para resolver problemas de programación lineal que tienen pocas restricciones” (NN, 2016).

Cottle, R. W. y Goldfarb, D. (1993): Festschrift in honor of Philip Wolfe, North Holland.

Crowder, H. (2016): “In memoriam: Philip Starr Wolfe”, Informs, 29 de diciembre.

NN (2016): “Philip Wolfe”, Informs, 29 de diciembre.