

Práce se věnuje úlohám vícestupňového stochastického programování v kontextu různých způsobů reprezentace náhodného procesu. Základní formou reprezentace náhodného procesu je scénářový strom. V práci jsou popsány vlastnosti obecného a po stupních nezávislého scénářového stromu. Dále je rozebrán případ scénářového stromu závislého na stavech markovského řetězce. Stavy markovského řetězce reprezentují období krize a období bez krize. Nakonec je, pomocí informace o historickém počtu krizových období, použita scénářová mřížka. Scénáře pro scénářové stromy jsou generovány metodou momentů. Scénářové struktury jsou použity jako vstup do optimalizačního problému privátního investora.