

Posudek vedoucího na diplomovou práci

Scénářové struktury ve více-
stupňových stochastických úlohách
Bc. Milan Harcek

OBSAH PRÁCE

Tato práce se zabývá scénářovými strukturami, které se používají ve více-
stupňových stochastického programování jako reprezentace (aproximace) náhodných
procesů. Po úvodu je první kapitola věnována klasickým formulacím úloh více-
stupňového stochastického programování. Ve druhé kapitole jsou představeny tři
základní scénářové struktury: obecný scénářový strom, markovský scénářový strom a
scénářová mřížka. Ve třetí kapitole je popsán investiční problém, který se pak v
praktické části řeší. Čtvrtá kapitola je věnována generování scénářů.

Vlastním příspěvkem autora je pátá kapitola, kde prezentuje výsledky investičního
problému pro pětistupňovou úlohu pro tři různé typy scénářových struktur.

HODNOCENÍ PRÁCE

Jedná se o druhou verzi této práce, kde autor odstranil ty nejzávažnější nedostatky a
hlavně dopracoval empirickou část práce v souladu se zadáním práce. Diplomový úkol
tím byl splněn, i když v některých případech jenom tím nejjednodušším způsobem,
např. postupních nezávislé stromy, Markovské řetězce pouze se dvěma stavy, atd.

ZÁVĚR

Navrhuji uznat předloženou práci jako diplomovou.

V Praze 3.9.2019

doc. RNDr. Ing. Miloš Kopa, Ph.D.