

Tato práce se zabývá problémem stochastického programování, a to zejména v souvislosti s rozděleními s těžkými chvosty a optimalizací portfolia. V první části je nejprve zpracována tematika stochastického programování a typy úloh, které se v rámci této problematiky vyskytují. Ve druhé části je zpracováno řešení úloh stochastického programování metodou SAA, a to zejména v případě náhodných veličin s rozděleními s těžkými chvosty. V závěru je teorie aplikována na problém optimalizace portfolia a v programu R je provedena numerická studie na základě reálných dat, získaných z webové stránky Google Finance.