

V této práci se zabýváme algoritmy pro řešení dvoustupňových stochastických úloh. V první kapitole jsou uvedeny teoretické vlastnosti účelové funkce a množiny omezení, jenž jsou nezbytné pro pochopení fungování algoritmů. V závěru jsou diskutovány podmínky optimality. Druhá kapitola se zabývá algoritmy pro řešení úloh s lineární účelovou funkcí. V první části je podrobně vysvětlena základní forma L-shaped algoritmu. Druhá část je věnována algoritmu stochastické dekompozice včetně popisu regularizované verze. Poslední kapitola práce slouží k praktickému porovnání uvedených algoritmů na třech aplikačních příkladech. Každá úloha je nejprve teoreticky popsána a poté vyřešena oběma uvedenými algoritmy.