

Záróvizsga tételsor a Sztochasztikus programozás tárgyból

1. Várható hiány (Expected Shortfall) és CVaR (Conditional Value-at-Risk). Sztochasztikus dominancia. Matematikai jellemzésük és hatékony kezelésük optimalizálási feladatokban.
2. Kétlépcsős sztochasztikus programozási feladat és megoldó eljárásai.
3. Valószínűséggel korlátozott sztochasztikus programozási modellek és azok matematikai tulajdonságai.
4. A valószínűséggel korlátozott sztochasztikus programozási modellekből származó feladatokban szereplő valószínűségi függvények értékének és gradiensének numerikus meghatározása.
5. Nemlineáris programozási algoritmusok adaptálása valószínűséggel korlátozott sztochasztikus programozási feladatok megoldására.

Budapest, 2022. június 13.

Szántai Tamás
prof. emeritus

és

Fábián Csaba
egyetemi tanár