



Faculté de sciences appliquées

INMA2473 Recherche opérationnelle: méthodes stochastiques et dynamiques

[30h+22.5h exercices] 5 crédits

Ce cours bisannuel est dispensé en 2007-2008, 2009-2010,...

Cette activité se déroule pendant le 1er semestre

Enseignant(s): Yves Smeers
Langue d'enseignement : français
Niveau : Deuxième cycle

Objectifs (en termes de compétences)

Familiariser les étudiants avec les problèmes particuliers posés par les modèles multipériodes avec paramètres incertains.

Objet de l'activité (principaux thèmes à aborder)

Programmation stochastique et dynamique et applications.

Résumé : Contenu et Méthodes

Programmes dynamiques linéaires stochastiques : formulations et interprétation
Algorithmes d'agrégation de scénarios pour la programmation dynamique stochastique
Méthodes de décompositions pour programmes stochastiques
Valeur ajustée au risque cohérente à une ou plusieurs périodes
Approximation de problèmes stochastiques et méthodes de réduction de scénarios
Relaxation lagrangienne de problèmes stochastiques avec variables entières

Autres informations (Pré-requis, Evaluation, Support, ...)

Néant