

## CURSO: INTRODUCCIÓN A LA PROGRAMACIÓN ESTOCÁSTICA

11-14 de marzo de 2014

**Gerardo Pérez Valdés**

NTNU-Trondheim (Norwegian University of Science & Technology)

### Horario:

15:30-19:00

### Programa tentativo:

#### Day 1

- Introduction to Stochastic Programming
- Uncertainty
- Stochastic Model
- Scenario Trees
- Deterministic Equivalent model
- Value of Stochastic Solution

#### Day 2

- Solution Methods
- Why Solution Methods?
- Benders Decomposition
- The L-Shaped Method
- Lagrangean Decomposition
- Stochastic Decomposition

#### Day 3

- Scenario Generation and Reduction
- Stability
- Simple Sampling
- Moment Matching
- Copulas
- Scenario Reduction

#### Day 4

- Branch and Fix Coordination algorithm and its implementation
- Decomposition
- The algorithm
- The implementation
- Current Efforts

---

**Organizadores:** Alfredo Bermúdez de Castro ([alfredo.bermudez@usc.es](mailto:alfredo.bermudez@usc.es)) y Julio González ([julio.gonzalez@usc.es](mailto:julio.gonzalez@usc.es))

**Dirigido a:** Curso abierto a toda la comunidad universitaria

**Inscripción:** Es gratuita. De cara a la gestión logística, se agradecería la inscripción antes del 6 de marzo ([mariajose.ginzo@usc.es](mailto:mariajose.ginzo@usc.es))

**Lugar:** Aula pendiente de confirmación - Facultad de Matemáticas. Si hay suficiente interés desde los Campus de Vigo y Coruña se estudiará la posibilidad e impartir el curso por vídeo-conferencia, para ello es muy importante **inscribirse**.

**Créditos:** El curso es valedero por *un crédito* en el programa de doctorado "*Métodos Matemáticos y Simulación Numérica en Ingeniería y Ciencias Aplicadas*".

Financiado por:



XUNTA DE GALICIA

CONSELLERÍA DE EDUCACIÓN  
E ORDENACIÓN UNIVERSITARIA

