

SEMINARAS

2023 kovo 21 d. 09:00 SRL-I 420

Ana Ušpurienė

Stochastinio optimizavimo ir statistinio modeliavimo algoritmų tyrimas bei taikymas

Disertacijoje nagrinėjamos problemos, susijusios su stochastinio programavimo metodų taikymu sprendžiant finansų optimizavimo uždavinius. Darbe analizuojami pagrindiniai stochastinio programavimo uždaviniai, aprašomi pagrindiniai šių uždavinių sprendimo algoritmai ir metodai. Apibūdinami svarbiausi finansų valdymo elementai, aprašomi pagrindiniai metodai taikomi finansų modeliavimui bei optimizavimui, sukurti metodai ir modeliai, kurie buvo taikomi sprendžiant finansų modeliavimo ir optimizavimo uždavinius: formuluojamas modifikuotas dviejų etapų tiesinio stochastinio uždavinio algoritmas, aprašomas atliktas scenarijų agregavimo tyrimas, formuluojamas veikla pagrįsto savikainos skaičiavimo (ABC) metodu pagrįstas dviejų etapų stochastinio programavimo uždavinys, pritaikytas teisėtvarkos bei sveikatos apsaugos srityse, formuluojamas dviejų etapų trumpojo laikotarpio įmonės finansų planavimo modelis, universiteto išlaidų planavimo modelis, skirtas viešųjų įstaigų finansinių srautų planavimui bei aprašomas finansinių instrumentų efektyvumo tyrimas. Disertacijos tema paskelbti devyni straipsniai, iš jų du referuojami Clarivate Analytics DB, bei perskaityti keturi pranešimai konferencijose.

Kviečiame dalyvauti.
Seminaro sekretorius A. Bugajev