

Description d'article

Armand Fouquiau, Romany Stéphane

Université Paris-Sud

Octobre 2017

Cette article a pour but de de combler le vide littéraire concernant une famille de programmes stochastique : Stochastic Mixed-Integer Convexe Programs.

Toutes les décisions prises pour chaque scénario à l'instant $t - 1$ sont prises en compte à l'instant t . La fonction d'association $X(\xi_s) = x_s$ implique que x_s dépend des variables aléatoires de la distribution ξ .

La prise de décision se fait suivant des scénarios des sous problèmes de la forme : $f(x_s, \xi_s) = \min\{f_s(x_s)\} | x_s \in C_s, x_s \in \mathbb{R}^{n_r} \times \mathbb{Z}^{n_z}$
Avec $n = n_r + n_z$, la taille du vecteur x_s