

Obsah

1	Vícekriteriální rozhodování metodou PROMETHEE (program Visual PROMETHEE)...	1
1.1	Stanovení vah kritérií.....	2
1.2	Přístupy k vícekriteriálnímu rozhodování	2
1.3	Metoda PROMETHEE	4
1.4	Příklad aplikace metody PROMETHEE	8
1.4.1	Zadání příkladu	8
1.4.2	Řešení příkladu se software Visual PROMETHEE	8
	Literatura	21
2	Simulace Monte Carlo s počítačovou podporou (program @Risk).....	23
2.1	Simulace Monte Carlo	24
2.1.1	Podstata a postup simulace Monte Carlo	24
2.1.2	Počítačová podpora simulace Monte Carlo.....	31
2.1.3	Příklad aplikace simulace Monte Carlo v investičním rozhodování.....	32
2.2	Návod na obsluhu programu @Risk.....	36
2.2.1	Umístění programu @Risk na počítačích	36
2.2.2	Příprava simulace	36
2.2.3	Výsledky (výstupy) simulace	45
	Literatura	50
3	Analýza a řešení rozhodovacích stromů s počítačovou podporou (Program Precision Tree)	51
3.1	Víceetapové rozhodovací procesy a rozhodovací stromy	52
3.1.1	Jednoetapové a víceetapové rozhodovací procesy	52
3.2	Program Precision Tree pro analýzu a řešení rozhodovacích stromů	61
3.2.1	Charakteristika hlavního menu programu	61
3.2.2	Tvorba rozhodovacích stromů s programem Precision Tree.....	64
3.2.3	Stanovení optimální strategie pomocí stromu	82
3.2.4	Analýza rozhodovacích stromů	82
3.2.5	Funkce užítku	106
3.2.6	Simulace Monte Carlo v rozhodovacích stromech.....	111

Literatura	118
4 Optimalizace portfolia projektů za rizika s počítačovou podporou (program Risk Optimizer)	122
4.1 Povaha úlohy tvorby portfolia projektů	123
4.2 Optimalizace portfolia projektů pomocí modelu bivalentního programování	125
4.2.1 Charakteristika optimalizační úlohy	125
4.2.2 Optimalizace portfolia projektů za rizika	127
4.2.3 Příklad optimalizace investičního portfolia pomocí deterministického ekvivalentu úlohy stochastické optimalizace	129
4.3 Aplikace programu RiskOpt pro optimalizaci investičního portfolia	133
4.3.1 Stanovení rizika portfolia	133
4.3.2 Charakteristika programu RiskOpt	135
4.3.3 Příklad optimalizace investičního portfolia	136
4.4 Investiční portfolia se statisticky závislými projekty	149
4.4.1 Vliv statistické závislosti projektů na kritéria hodnocení investičního portfolia	149
4.4.2 Diverzifikace a systematické riziko	153
4.5 Průvodce programem RiskOpt pro stochastickou optimalizaci	155
4.5.1 Vyvolání programu RiskOpt	155
4.5.2 Zadání optimalizačního modelu (Model Definition)	156
4.5.3 Zadání parametrů optimalizace (Optimization Settings)	164
4.5.4 Zahájení, průběh a výsledky optimalizace	173
4.5.5 Měkká omezení a penalizační funkce	180
Literatura	183