

随机能力规划的Scenario模型及其决策风险分析

张人千,王如平

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 为研究随机环境下的生产能力扩张问题,采用Scenario方法,建立了市场需求量和产品价格为随机变量的多计划期能力规划决策模型.其中考虑了两种情况:一是能力投资方案不随市场需求的随机实现而变化的预报型模型,二是投资方案可以跟踪市场需求随机实现的适应型模型.算例研究比较了这两种模型的决策效果.进一步,使用下方风险分析,探讨了随机能力扩张的投资决策风险,建立了考虑期望收益风险的预报型能力规划决策模型.该模型在随机规划中加入了一个期望下方风险约束,以反映决策者的风险偏好,基于算例讨论了考虑风险和不考虑风险时的决策差异.

关键词 [随机能力规划](#) [Scenario](#) [期望下方风险](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009010055](#)

通讯作者:

作者个人主页: 张人千;王如平

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#) (948KB)

▶ [\[HTML全文\]](#) (0KB)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [引用本文](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“随机能力规划” 的相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [张人千](#)

· [王如平](#)