

Un modelo de mínimo regret esperado con distribuciones dependientes de la solución para el problema del camino más corto.

Eduardo Conde .

Abstract

Consideramos un problema de optimización en el que el coste de cada solución factible depende del escenario que se verifique. Se define el regret de una solución bajo un escenario prefijado como la diferencia entre su coste y el coste óptimo bajo dicho escenario. Aunque el escenario que tendrá lugar es incierto se supone conocida su distribución de probabilidad y se evalúa la solución a través de su regret esperado. Por último, supondremos que la distribución de probabilidad del escenario depende de la solución que está siendo evaluada. En estas condiciones se estudia un modelo de optimización para el problema del camino más corto. Esta aproximación puede ser usada para generar modelos de optimización robusta en los que el grado de conservadurismo es calibrado usando diferentes familias de distribución de probabilidad para el escenario que definirá el sistema.