

VORträge zum Operations Research

Kolloquium des Instituts für Operations Research

Zeit: Donnerstag, 20. Januar 2011, 17:30 Uhr

Ort: Raum 109, Gebäude 20.13

Es spricht: Dr. Radu Ioan Boț, Mathematisches Institut,
Heinrich-Heine-Universität Düsseldorf

Zum Thema: **Über die Rolle der Qualifikationsbedingungen bei der Herleitung von dualen Darstellungen für konvexe Risikomaße**

Abstract: In der konvexen Optimierungstheorie ist die starke Dualität für eine primale restringierte Optimierungsaufgabe und ihr Lagrange-duales Problem im Allgemeinen nicht gesichert. In diesem Zusammenhang spielen Qualifikationsbedingungen eine wichtige Rolle, auf deren Bedeutung in dem Vortrag näher eingegangen wird. Dabei wird die Unabdingbarkeit dieser Bedingungen bei der Formulierung von exakten Subdifferentialformeln und, damit verbunden, von notwendigen und hinreichenden Optimalitätsbedingungen bei restringierten konvexen Optimierungsaufgaben unterstrichen.

Im ersten Teil des Vortrages werden neben den klassischen verallgemeinerten Inneren-Punkt-Bedingungen Qualifikationsbedingungen betrachtet, die sich mit Hilfe des Quasi Inneren und des Quasi-Relativ Inneren formulieren lassen. Die Vorteile der letzteren gegenüber den klassischen Inneren-Punkt-Bedingungen werden erläutert.

Im zweiten Teil dieses Vortages wird eine Reihe von Anwendungen der konvexen Dualitätstheorie bei der Herleitung von dualen Darstellungen für konvexe Risikomaße behandelt.

Die Vorträge zum Operations Research wenden sich an alle Interessierten!

Ab 17:00 Uhr ist am Institut für Operations Research (Gebäude 20.13, Raum 104) Gelegenheit zu einem Gespräch mit dem Referenten bei einer Tasse Kaffee gegeben.

Bei Rückfragen wenden Sie sich bitte an:

Prof. Dr. Oliver Stein, Institut für Operations Research.