

mgr Hubert Asienkiewicz

Uniwersytet Zielonogórski, Wydział Matematyki, Informatyki i Ekonometrii

Rekursywna użyteczność w decyzyjnych procesach Markowa

W referacie zostanie przedstawione programowanie dynamiczne z entropijną miarą ryzyka. Zostanie sformułowane zmodyfikowane równanie Bellmana oraz omówiony schemat jego rozwiązania z uwzględnieniem czynnika ryzyka. Strategia otrzymana po rozwiązaniu powyższego równania będzie optymalną polityką stacjonarną.

Przedstawiony model jest wrażliwy na ryzyko, ma więc praktyczne zastosowanie np. w finansach. W celu łatwiejszego zobrazowania rezultaty będą przedstawione także za pomocą przykładów.