

Anna Jaśkiewicz
Politechnika Wroclawska

Markowskie procesy decyzyjne z quasi-hiperbolicznym dyskontowaniem

W pracy rozważane są markowskie procesy decyzyjne z borelowską przestrzenią stanów i czasem dyskretnym. Zamiast standardowego dyskontowania decydent stosuje dyskontowanie quasi-hiperboliczne do zdefiniowania swojej wypłaty w nieskończonym horyzoncie czasowym. Do rozwiązania problemu zastosowano koncepcję (stacjonarnej) równowagi markowskiej i pokazano, że ona istnieje, gdy prawdopodobieństwa przejścia posiadają gęstość. W referacie pokazane zostaną przykłady i różnice w strategiach dla modeli ze standardowym dyskontowaniem i dyskontowaniem hiperbolicznym.