

Anna Jaśkiewicz, Andrzej S. Nowak
Politechnika Wrocławska, Uniwersytet Zielonogórski

Dyskontowane programowanie dynamiczne z nieograniczonymi funkcjami wypłaty

W pracy studiowane są markowskie procesy decyzyjne na nieprzeliczalnej przestrzeni stanów z nieograniczonymi funkcjami wypłaty. Celem jest zaprezentowanie nowego warunku tzw. warunku wzrostu nałożonego na dodatnią część funkcji wypłaty, który gwarantuje istnienie rozwiązania równania Bellmana. Równanie to otrzymywane jest poprzez algorytm iteracji wartości. Ponadto podamy przykłady, w których to założenie jest spełnione, a tradycyjne podejście przez normy ważone nie może być zastosowane bądź dopuszcza tylko niektóre wartości współczynnika dyskonta.