

Anna Jaśkiewicz
Politechnika Wroclawska
Instytut Matematyki i Informatyki

Nierówność optymalności dla kryterium średniego kosztu wrażliwego na ryzyko

W pracy rozważane są markowskie procesy decyzyjne na przestrzeniach borelowskich z kryterium średniego kosztu wrażliwym na ryzyko. Celem referatu jest zaprezentowanie rozwiązania nierówności optymalności i otrzymanie strategii optymalnej. Jednocześnie zostanie przedstawiony przykład pokazujący różnicę pomiędzy omawianym kryterium a standardowym kryterium średniego kosztu.