

Łukasz Stettner
IMPAN

O dyskretyzacji problemów zatrzymywania na skończonym horyzoncie czasowym procesów Markowa z czasem ciągłym

W wystąpieniu będą przedstawione metody dyskretyzacji względem zmiennej czasowej zagadnień optymalnego zatrzymywania procesów Markowa z czasem ciągłym. Będziemy bezpośrednio dyskretyzować problem zatrzymywania z czasem ciągłym, bądź też będziemy dyskretyzować intensywność zatrzymywania w równaniu kary, które przybliży pierwotne zagadnienie stopowania. Wprowadzona będzie metoda kary dla problemów z czasem dyskretnym, jak również pokazana będzie metoda deterministycznego zatrzymywania równoważna stochastycznemu problemowi zatrzymywania w czasie dyskretnym. Przedstawione wyniki opierają się na pracy

Ł. Stettner, *Discrete time approximations of continuous time finite horizon stopping problems*, praca złożona.