

Damian Jelito

Uniwersytet Jagielloński, Instytut Matematyki

E-mail: damian.jelito@im.uj.edu.pl

Wrażliwe na ryzyko problemy optymalnego stopowania i niejednoznaczność rozwiązania równania Bellmana

Przedstawimy wyniki dotyczące wrażliwych na ryzyko problemów stopowania optymalnego z nieskończonym horyzontem dla standardowych procesów Markowa z własnością Fellera. Pokażemy, że odpowiadające problemowi równanie Walda–Bellmana może mieć wiele rozwiązań, przedstawimy probabilistyczną interpretację największego i najmniejszego z nich oraz sformułujemy warunek gwarantujący jedyność. Uzyskane wyniki zostaną zilustrowane prostymi przykładami z wyznaczonymi jawnie niejednoznaczными rozwiązaniami równania Bellmana. Referat oparty jest na pracy [1] napisanej wspólnie z Ł. Stettnerem (IMPAN) i rozszerza wyniki zawarte w pracy [2].

Bibliografia

- [1] D. Jelito, Ł. Stettner, *Risk-sensitive optimal stopping with unbounded terminal cost function*, *Electronic Journal of Probability* 27 (2022), Paper No. 4, 30 pp.
- [2] D. Jelito, M. Pitera, Ł. Stettner, *Risk sensitive optimal stopping*, *Stochastic Processes and their Applications* 136 (2021), 125–144.