

Στοχαστικές στρατηγικές
Τμήμα Μαθηματικών, ΑΠΘ
Ακαδημαϊκό έτος 2018-2019

Προαιρετική άσκηση σε στοχαστικά προβλήματα διαδρομής

Δίνεται το διπλανό δικτυωτό. Να βρεθεί με τη μέθοδο ανοιχτού κύκλου, το πρόβλημα διαδρομής μέγιστου κέρδους από το σημείο A ως την τελική ευθεία ($x=2$). Μια εντολή εκτελείται με πιθανότητα $p=0.4$ σε κάθε κόμβο. Ποια είναι η διασπορά του κέρδους της βέλτιστης εντολής και τι εκφράζει;

