

Στοχαστικές στρατηγικές  
Τμήμα Μαθηματικών, ΑΠΘ  
Ακαδημαϊκό έτος 2018-2019

Προαιρετική άσκηση σε στοχαστικά προβλήματα διαδρομής

Δίνεται το διπλανό δικτυωτό στο οποίο τα τόξα παριστάνουν κέρδος. Μια εντολή εκτελείται με πιθανότητα  $p=0.4$ .

α) Να βρεθεί με τη **μέθοδο ανοιχτού κύκλου** η βέλτιστη πολιτική εντολών ώστε να μεγιστοποιείται το κέρδος από το σημείο A ως την τελική ευθεία ( $x=2$ ).

β) Να βρεθεί με τη **μέθοδο ανοιχτού κύκλου με επαναληροφόρηση** η βέλτιστη πολιτική εντολών ώστε να μεγιστοποιείται το κέρδος από το σημείο A ως την τελική ευθεία ( $x=2$ ).

