El Departamento de estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

ALGUNOS RESULTADOS EN CONTROL DE PROCESOS MARKOVIANOS

impartirá

Rosario Romera
Universidad Carlos III de Madrid
Depto. de Estadística y Econometría

RESUMEN

Los modelos de decisión (o control) markovianos han sido tradicionalmente utilizados en ámbitos de Ingeniería de control y Optimización en Economía. Más recientemente, se ha despertado un interés creciente desde el área de Finanzas y Seguros por este tipo de modelos. En esta charla se presentarán los elementos que componen estos modelos, así como situaciones reales cuya formulación y solución se resuelve en un modelo de decisión markoviano. Para el caso de tiempo discreto se presentarán dos resultados recientes. El primero se refiere al estudio de la existencia de políticas o estrategias óptimas, cuando el problema es multicriterio y con costes no acotados. El segundo resultado, se centra en el caso de sistemas no directamente observables, caso muy frecuente en problemas de ingeniería. Estos sistemas han sido extensamente estudiados en el caso de costes acotados. El trabajo que se presentará, fija las condiciones que garantizan la existencia de políticas óptimas con costes no acotados para sistemas parcialmente observables. Se comentarán posibles líneas de extensión de estos trabajos.

Fecha: Miércoles 4 de Diciembre
Hora: 12:30
Salón: Sala de Video II Biblioteca, 2. Piso

Lista de seminarios próximos. Visite:
www.stat.itam.mx/Seminarios/Proximos.html

El Seminario Aleatorio está destinado tanto a profesores como a estudiantes, por lo que el Departamento de estadística agradece a los profesores que colaboren invitando a sus alumnos a estas sesiones.