

马氏决策规划的加速逼近算法与最小方差问题

董泽清

中国科学院数学研究所

收稿日期 1976-12-11 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 我们涉及的折扣马氏决策规划(有些著者称为马氏决策过程), 具有状态空间与每个状态可用的决策集均为可数无穷集、次随机转移律族、有界报酬函数. 给出了一个求 $(\epsilon_)$ 最优平稳策略的加速收敛逐次逼近算法, 比White的逐次逼近算法更快地收敛于 $(\epsilon_)$ 最优解, 并配合有非最优策略的检验准则, 使算法更加得益. 设 β 为折扣因子, 一般说 β (或 (ϵ, β))_最优平稳策略, 往往是非唯一的, 甚至与平稳策略类包含的策略数一样多. 我们自然希望在诸 β (或 (ϵ, β))_最优平稳策略中寻求方差齐次地(关于初始状态)达 $(\epsilon_)$ 最小的策略. 我们证明了这种策略确实存在, 并给出了获得这种策略的算法.

关键词

分类号

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [复制索引](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 无 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
- [董泽清](#)

Abstract

Key words

DOI:

通讯作者