

| | |
|--|-----|
| <u>Einleitung</u> | ix |
| <u>Kapitel 0. Einführung</u> | |
| §1 Glücksspiele | 1 |
| <u>Kapitel 1. Markoff-Ketten mit diskretem Zeitparameter</u> | |
| §2 Definition und Grundlagen | 11 |
| §3 Beispiele | 16 |
| 1. Ein Lagerhaltungsmodell | 16 |
| 2. Das Warteschlangenmodell M/G/1 | 16 |
| 3. Der diskrete Erneuerungsprozeß | 18 |
| 4. Das Sekretärinnenproblem | 21 |
| 5. Verzweigungsprozesse | 24 |
| 6. Markoff-Ketten mit zwei Zuständen | 28 |
| §4 Die eingebetteten Erneuerungsprozesse | 30 |
| §5 Die Klassenstruktur | 40 |
| §6 Stationäre Verteilungen und asymptotisches Verhalten | 44 |
| §7 Markoff-Ketten mit endlichem Zustandsraum | 55 |
| §8 Optimales Stoppen | 62 |
| <u>Kapitel 2. Stochastische dynamische Optimierung</u> | |
| §9 Das Markoffsche Entscheidungsmodell | 72 |
| §10 Beispiele | 79 |
| 1. Ein Lagerhaltungsmodell | 79 |
| 2. Ein Ersetzungsmodell | 82 |
| 3. Das M/G/1-Warteschlangenmodell mit kontrollierbarer Bedienung | 83 |
| 4. Das Glücksspielmodell | 85 |
| 5. Das Stoppproblem | 85 |
| 6. Semi-Markoffsche Modelle | 86 |
| §11 Optimalität bei endlichem Horizont | 87 |
| §12 Strukturierte Strategien | 94 |
| §13 Unendlich stufige negative Modelle | 100 |
| §14 Unendlich stufige diskontierte Modelle | 108 |
| §15 Unendlich stufige positive und verlässbare Modelle | 116 |

| | |
|---|-----|
| §16 Das Durchschnittsgewinnkriterium | 124 |
| §17 Unendlich stufige undiskontierte Modelle | 135 |
| §16 Fortsetzung | 143 |
| §18 Unendlich stufige \lim -sup-Modelle | 147 |
| §19 Ein allgemeines Stoppmodell | 165 |
| Literatur | 174 |
| Verzeichnis der verwendeten Abkürzungen und Symbole | 178 |
| Sachverzeichnis | 181 |