

# INHALTSVERZEICHNIS

<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