

Stochastische Prozesse und Optimierung

Übungsblatt 9, SoSe 14

18) Gegeben sei ein Markoffsches Entscheidungsmodell im Sinne der Def. 4.1.
Zeigen Sie für $v \in B(S)$ die Gültigkeit von Bemerkung 4.10.

19) Beweisen Sie die Äquivalenz aus Lemma 4.15.

Hinweis:

Benutzen Sie, daß für $B \in \mathbb{N}$ eine monoton fallende Funktion

$h: \{0, 1, \dots, B\} \rightarrow \mathbb{R}$ darstellbar ist

als

$$h(l) = c_0 - \sum_{k=1}^l c_k, \quad l = 0, 1, \dots, B,$$

mit $c_0 \in \mathbb{R}$ und $c_k \in \mathbb{R}_+$ für $k = 1, \dots, B$.