



INTRODUCCIÓN A LOS PROCESOS DE DECISIÓN DE MARKOV BAJO EL CRITERIO DE ENTROPÍA RELATIVA

GLADYS DENISSE SALGADO SUÁREZ¹, JOSÉ DIONICIO ZACARIAS FLORES¹, HUGO ADAN CRUZ SUÁREZ¹ y FERNANDO VELASCO LUNA¹

¹ Facultad de Ciencias Físico Matemáticas. gladys008@hotmail.com

El estudio de Procesos de Decisión de Markov ha sido rico por la variedad de sus aplicaciones, una de ellas es el área de finanzas donde el problema central es determinar una estrategia de inversión que optimice el valor del portafolio y por lo tanto incorpore ventajas competitivas, sin embargo, desde el punto de vista de la teoría de la información, es notable la falta de información, por tal motivo, para abordar este tipo de problemas, es necesario introducir un criterio que mida el costo esperado de la información al ejecutar alguna política determinada, de esta manera, el interés se enfoca en la búsqueda de políticas óptimas en el sentido que permitan alcanzar el máximo valor, dada una restricción sobre el control de la información, en este trabajo se plantea el problema de control bajo el criterio de entropía relativa para espacios Borel, como respuesta a éste problema, iniciando con esto la investigación en la búsqueda de la solución. Se enlistan las principales referencias para el trabajo.