

Optimización Dinámica

Profesor: Enrique Calfucura.

Ayudante: Alejandro Poblete.

Ayudantía N°7

Junio 2020

1. Encuentre las funciones de valor y de política del siguiente problema:

$$\max \sum_0^{\infty} \beta^t \left(-\frac{2}{3} x_t^2 - u_t^2 \right), \quad x_{t+1} = x_t + u_t, \quad \text{con } x_0 > 0$$

2. Considere el siguiente problema:

$$\max \sum_0^{\infty} \beta^t \left(-e^{-u_t} - \frac{1}{2} e^{-x_t} \right), \quad x_{t+1} = 2x_t - u_t, \quad x_0 \text{ dado}$$

Defina las funciones de política y valor.