



ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΙΩΑΝΝΙΝΩΝ

ΤΜΗΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΙΚΩΝ



Εβδομαδιαίο Σεμινάριο

OPTIMAL (s, S) POLICIES FOR JUMP INVENTORY MODELS

Lakdere Benkherouf

Department of Statistics and Operations Research, Kuwait University

In this talk, a single item stochastic inventory model where demand is driven by a piecewise deterministic process, will be presented. The model appears to be a natural extension to some existing deterministic models. Then, the optimal impulse control policy which minimizes the inventory costs over an infinite horizon will be discussed along with a Quasi-Variational Inequality (QVI) formulation. It turns out that the solution of the QVI corresponds to the classical (s, S) policy.

Τετάρτη 1 Φεβρουαρίου 2012, 5:30μμ

Αίθουσα 201α Τμήματος Μαθηματικών

Μετά την ομιλία ακολουθεί καφές και συζήτηση στο εντευκτήριο του Τμήματος