

PHƯƠNG PHÁP MOTE CARLO GIẢI BÀI TOÁN ĐIỀU KHIỂN NGẪU NHIÊN TỔNG HỢP

Trần Thị Ngân, Trần Mạnh Tuấn

TÓM TẮT:

Bài toán điều khiển ngẫu nhiên tổng hợp có ứng dụng rộng rãi trong nhiều lĩnh vực và đã được các nhà khoa học trong và ngoài nước giải quyết. Khi nghiên cứu các phương pháp số giải các bài toán điều khiển tối ưu với ràng buộc biến trạng thái, nhiều tác giả nước ngoài đã sử dụng các phương pháp gián tiếp (thông qua việc thiết lập các nguyên lý cực đại) để chuyển về các bài toán quy hoạch (trong dạng ngẫu nhiên hoặc tất định). Một công cụ hữu hiệu để giải bài toán đặt ra là sử dụng phương pháp mô phỏng số Monte Carlo