



Almo Collegio Borromeo

DYNAMIC PROGRAMMING OPTIMAL CONTROL AND APPLICATIONS

prof. **STEFANO DEMICHELIS**
Università degli Studi di Pavia

Lezione 1

Giovedì 12 novembre 2009 Introduzione al corso: ottimizzazione

Lezione 2

Mercoledì 18 novembre 2009 Programmazione convessa

Lezione 3

Giovedì 19 novembre 2009 Programmazione lineare

Lezione 4

Mercoledì 25 novembre 2009 Esempi ed applicazioni

Lezione 5

Giovedì 26 novembre 2009 Programmazione dinamica in tempo discreto
Condizioni per un ottimo
Equazioni di Euler Lagrange e di Bellman

Lezione 6

Mercoledì 2 dicembre 2009 Esempi ed applicazioni
Generazioni sovrapposte, modello di Ramsey

Lezione 7

Giovedì 3 dicembre 2009 Modelli con moneta nella funzione di utilità
Modello di Lucas

Lezione 8

Mercoledì 13 gennaio 2010 Modello di Bewly-Townsend

Lezione 9

Giovedì 14 gennaio 2010 Programmazione in tempo continuo. Controllo ottimale
Il principio del massimo di Pontryagin e applicazioni

Lezione 10

Mercoledì 20 gennaio 2010 Equazione di Hamilton-Jacobi-Bellman

Lezione 11

Giovedì 21 gennaio 2010 Giochi Differenziali
Equazione di Isaacs

Lezione 12

Mercoledì 27 gennaio 2010 Giochi Differenziali in Macroeconomia
Modelli con autorità fiscale e banca centrale con
diversi obiettivi.



Università degli Studi
di Pavia

**Le lezioni si svolgono dalle ore 18 alle ore 20 presso il
Collegio Borromeo | Piazza Borromeo, 9 | Pavia**