

არასრული მონაცემებით ოპტიმალური გაჩერების შესახებ

ბესარიონ დოჭვირი

ელ-ფოსტა: besarion.dochviri@tsu.ge

მათემატიკის დეპარტამენტი, თბილისის სახელმწიფო უნივერსიტეტი, უნივერსიტეტის ქ. 13

არასრული მონაცემებით ოპტიმალური გაჩერების ამოცანა დაყვანილია სრული მონაცემებით ამოცანაზე და დამტკიცებულია ფასების კრებადობა. განხილულია კალმან-ბიუსის მოდიფიცირებული უწყვეტი $(\theta_t, \xi_t^\varepsilon)$, $0 \leq t \leq T$, მოდელი ნაწილობრივ დაკვირვებადი შემთხვევითი პროცესებისათვის. ვთქვათ, s^0 და s^ε ფასებია წრფივი მოგების ფუნქციის შემთხვევაში [1]. ჩვენ გვაქვს

$$\lim_{\varepsilon \rightarrow 0} s^\varepsilon = s^0,$$

სადაც $\varepsilon \rightarrow 0$ არის ξ^ε დაკვირვებადი პროცესის შეშფოთების მცირე პარამეტრი.

ლიტერატურა

[1] P. Babilua, I. Bokuchava, B. Dochviri, M. Shashiashvili. Convergence of costs in an optimal stopping problem for a partially observable model. AMIM, vol. 11, N 1, 2006, pp. 6-11.