

ساختار افق نهایی متغیر برای مسئله کنترل بهینه تصادفی تحت شرط مقید

پریسا ویس کرمی

دانشجوی کارشناسی ارشد ریاضی کاربردی، دانشگاه لرستان، لرستان، ایران

چکیده

در این مقاله، یک ساختار افق نهایی متغیر برای مسئله کنترل بهینه تحت قیود حالت مطرح می‌کنیم، که در آن زمان نهایی از متغیر کنترل تحت شرایط مقید پیروی می‌کند. با تمرکز بر روی این مسئله کنترل بهینه جدید، یک اصل ماکزیمم سازی تصادفی جدید را بررسی می‌کنیم، که با مسئله کنترل بهینه مرسوم تحت محدودیت‌های حالت متفاوت است. جفت بهینه‌ای از مدل کنترل بهینه را می‌توان از طریق این اصل ماکزیمم‌سازی تصادفی جدید استخراج کرد.

واژه‌های کلیدی: معادله دیفرانسیل تصادفی، اصل ماکزیمم‌سازی تصادفی، افق نهایی متغیر

مطالعات اقتصاد، مدیریت مالی و حسابداری

دوره ۷، شماره ۱، بهار ۱۴۰۰، صفحات ۵۷۹-۵۵۵