

O pewnej metodzie dowodu istnienia optymalnych strategii inwestycyjnych maksymalizujących średni wzrost portfela

W wystąpieniu będzie pokazane zastosowanie metody M. Schala z 1993 roku do badania zagadnień optymalizacji średniego wzrostu portfela. Metoda ta pozwala przy stosunkowo ogólnych założeniach pokazać istnienie optymalnych strategii, dla których zachodzi pewna nierówność pochodząca z równania Bellmana. Kluczem metody jest zastosowanie technik Schala do pokazania istnienia odpowiednich mierzalnych selektorów. Okazuje się, że ta sama metoda umożliwia nowe podejście do jedyności miar niezmienniczych dla procesów filtracji w przypadku niesterowanego zagadnienia z niepełną informacją.