

Damian Jelito

Uniwersytet Jagielloński, Instytut Matematyki

E-mail: damian.jelito@im.uj.edu.pl

Regularność problemów optymalnego stopowania z multiplikatywnym funkcjonałem kosztu

Rozważamy problem optymalnego stopowania procesu Markowa z funkcjonałem kosztu postaci

$$\mathbb{E}_x e^{\int_0^\tau g(X_s) ds + G(X_\tau)}$$

dla pewnych ciągłych, ograniczonych funkcji g i G , gdzie dodatkowo $g(\cdot) \geq c > 0$ dla pewnego c . Zakładając, że proces spełnia własność Fellera, pokazujemy ciągłość optymalnej wartości kosztu względem początkowego stanu procesu.