

AGAYEVA Ch.A., ALLAHVERDIYEVA J.J.

ON A STOCHASTIC OPTIMAL CONTROL WITH VARIABLE DELAY

Abstract

The stochastic optimal control problem with variable delay is considered. The necessary condition of optimality is obtained when the coefficient of diffusion depends on control.

Ağayeva Ç.A., Allahverdiyeva C.C.

DƏYİŞƏN GECİKMƏYƏ MALİK BİR STOXAŞTİK
OPTİMAL İDARƏETMƏ MƏSƏLƏSİ HAQQINDA

Gecikmə argumenti zaman dan asılı olan bir stoxastik optimal idarəetmə məsələsinə baxılıb. Diffuziya əmsali idarəetmədən asılı olduqda maksimum prinsipi isbat olundub.