

# ორნშტეინ–ულენბეკის პროცესის პარამეტრების შეფასების შესახებ

ლევან ლაბაძე

საქართველოს ტექნიკური უნივერსიტეტი, თბილისი, საქართველო,  
[levanlabadze@yahoo.com](mailto:levanlabadze@yahoo.com)

განიხილება ორნშტეინ–ულენბეკის პროცესი, რომელიც მოცემულია სტოქასტური დიფერენციალური განტოლებით უსასრულო განზომილებიან ჰილბერტის სივრცეში

$$dX_t = A(t)X_t dt + \sigma(t)dw_t.$$

შესწავლილია დრეიფის და ვოლატილობის კოეფიციენტების შეფასების ამოცანა. გამოყენებულია მაქსიმალური დასაჯერობის და უმცირეს კვადრატთა მეთოდების უსასრულო განზომილებიანი ვარიანტები. ნაჩვენებია შეფასების მალდებულობა და ასიმპტოტური ნორმალურობა. კვლევა ეყრდნობა [1] ნაშრომის შედეგებს

## ლიტერატურა

1. Babilua P., Nadaraya E., Sokhadze G. On Limit Properties of Maximal Likelihood Estimators in a Hilbert Space. Georgian Mathematical Journal. Vol. 22, Issue 2. 2015.p. 171-178.