

一类连续半鞅型随机微分方程解的随机稳定性

张健, 秦明达

北京科学技术大学数学力学系

收稿日期 1993-4-26 修回日期 1993-12-17 网络版发布日期 接受日期

摘要 本文利用 Lyapunov 函数方法, 讨论了时齐 Doleans-Dader-Protter 方程 $dX_t = \sigma(X_t) dM_t + b(X_t) dA_t$ ((M_t) 为连续局部平方可积鞅; (A_t) 为连续有限变差过程) 平凡解的随机稳定性。本文建立了随机稳定性的判定定理并给出了相应的 Lyapunov 函数的一种具体形式。

关键词 [随机微分方程](#) [连续半鞅](#) [Ito公式](#) [Lyapunov函数](#)

分类号

Abstract

Key words

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [复制索引](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“随机微分方程”的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)
- [张健](#)
- [秦明达](#)