

# Markov过程最优控制的最大值原理

胡瑛  
复旦大学数学研究所  
收稿日期 1987-9-8 修回日期 1988-12-2 网络版发布日期 接受日期  
摘要

本文在终端时间 $T$ 固定,目标集是 $L^2(\Omega, F_T, P; R^n)$ 中的具有限余维数的相对凸体的情况下,对一般指标Markov过程最优控制问题证明了最大值原理。本文主要采用向量测度值域定理的方法。

关键词  
分类号

Abstract

Key words

DOI:

通讯作者

扩展功能
本文信息
▶ <a href="#">Supporting info</a>
▶ <a href="#">PDF(0KB)</a>
▶ <a href="#">[HTML全文](0KB)</a>
▶ <a href="#">参考文献</a>
服务与反馈
▶ <a href="#">把本文推荐给朋友</a>
▶ <a href="#">加入我的书架</a>
▶ <a href="#">加入引用管理器</a>
▶ <a href="#">复制索引</a>
▶ <a href="#">Email Alert</a>
▶ <a href="#">文章反馈</a>
▶ <a href="#">浏览反馈信息</a>
相关信息
▶ <a href="#">本刊中 无 相关文章</a>
▶ 本文作者相关文章
· <a href="#">胡瑛</a>