

学术论文

# 带跳倒向随机微分方程最小 $g$ -上解

林清泉, 杨丰

中国人民大学财政金融学院

收稿日期 修回日期 网络版发布日期:

**摘要** 对带跳和一个右连左极的增过程作为惩罚项的倒向随机微分方程定义 $g$ -上解, 并得到极  
限定理, 作为其应用, 在变量 $(y, z, q)$ 受限条件下, 讨论该方程的最小 $g$ -上解存在唯一性.

**关键词** [倒向随机微分方程,  \$g\$ -上解, 受限条件](#)

分类号

## The Smallest $g$ -Supersolution for BSDE with Jumps

Lin Qinquan, Yang Feng

School of Finance, Renmin University of China

**Abstract** For Backward Stochastic Differential Equation with jumps and an increasing predictable RCLL process as its penalization term, we have defined  $g$ -supersolution for such a BSDE and obtained the limit theorem. As an application of the limit theorem, the existence and uniqueness of the smallest supersolution for BSDE with jumps and constraints on  $(Y, Z, q)$  is proved.

**Key words** [Backward stochastic differential equation,  \$g\$ -supersolution, constraint.](#)

DOI

通讯作者 林清泉

### 扩展功能

#### 本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(284KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献](#)

#### 服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [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“倒向随机微分方程,  \$g\$ -上解, 受限条件”的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
  - [林清泉](#)
  - [杨丰](#)