

论文

多维反射倒向随机微分方程的解对参数的连续依赖性

肖 华

山东大学威海分校应用数学系, 山东威海264209

摘要:

研究了多维反射倒向随机微分方程解的先验估计, 并证明了解关于参数具有连续依赖性.

关键词: 倒向随机微分方程 连续依赖性 障碍问题 比较定理

Continuous dependence of the solution of multi dimensional reflected backward stochastic differential equations on the parameters

XIAO Hua

Department of Applied Math., Shandong University At Weihai, Weihai 264209, Shandong, China

Abstract:

The prior estimates of multi-dimensional reflected backward stochastic differential equations are studied. It is proved that solution has dependence on the parameters of the equations.

Keywords: backward stochastic differential equations continuous dependence obstacle problems comparison theorem

收稿日期 2006-09-30 修回日期 1900-01-01 网络版发布日期 2006-10-24

DOI:

基金项目:

通讯作者: 肖 华

作者简介:

本刊中的类似文章

1. 张 慧 .不完全信息下推广的递归偏好[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(1): 62-68
2. 王光臣 .部分可观测信息下的线性二次非零和随机微分对策[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(6): 12-15
3. 杨维强,杨 丽 .倒向随机微分方程的非参估计及模拟[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(2): 34-38
4. 韩宝燕,朱 波,石玉峰 .非Lipschitz条件下的倒向随机微分方程的g-上解的极限定理[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(1): 8-13
5. 何 坤 .连续时间完备市场下利用BSDEs考虑套期保值问题[J]. 山东大学学报(理学版), 2008,43(2): 1-07
6. 刘 洁 .g-期望的保常性与 $g(y,0,t)=0$ 的关系[J]. 山东大学学报(理学版), 2008,43(2): 58-61
7. 郑石秋,周圣武,徐 峰 .带有双障碍的反射倒向随机微分方程的逆比较定理[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(10): 63-68
8. 杨维强,彭实戈 .期权稳健定价模型及实证[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(2): 69-73
9. 赵国庆 .g-期望下的最优停时问题[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(6): 27-30
10. 何 坤 .倒向随机微分方程解Z的比较定理[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(10): 1-04
11. 杨哲 .推广的倒向随机微分超前方程[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(6): 81-83
12. 释恒璐,邓 伟,綦 路 .最大数学期望的几个重要性质[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(2): 92-94

扩展功能

本文信息

Supporting info

PDF(200KB)

[HTML全文](0KB)

参考文献[PDF]

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

引用本文

Email Alert

文章反馈

浏览反馈信息

本文关键词相关文章

▶ 倒向随机微分方程

▶ 连续依赖性

▶ 障碍问题

▶ 比较定理

本文作者相关文章

▶ 肖 华

13. 释恒璐, .基于 $g$ -期望的Holder不等式[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(4): 28-31
14. 任永,秦衍 .非Lipschitz条件下倒向随机微分方程解的稳定性[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(6): 32-35
15. 释恒璐,郭冬梅 .生成元为线性增长函数的反射倒向随机微分方程[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(4): 57-60
16. 张 慧,聂秀山 .Knight不确定环境下欧式股票期权的最小定价模型[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(11): 121-126
17. 林乾,石玉峰 .一般 $g$ -期望的收敛定理[J]. 山东大学学报(理学版), 2008,43(6): 28-30
18. 黄宗媛 张峰.一类高维抛物型偏微分方程的粘性解[J]. 山东大学学报(理学版), 2008,43(12): 5-9
19. 付静 1 ,郝涛2 . $g$ -期望的一种Kolmogorov不等式[J]. 山东大学学报(理学版), 2009,44(1): 79-83