

论文

局部Lipschitz条件下的正倒向重随机微分方程

朱庆峰<sup>1</sup>,石玉峰<sup>2</sup>

1. 山东财政学院 统计与数理学院, 山东 济南 250014; 2. 山东大学 数学与系统科学学院, 山东 济南 250100

摘要:

在局部Lipschitz条件下,得到了任意给定时间区间上,正倒向重随机微分方程解的存在惟一性结果。

关键词: 随机分析 正倒向重随机微分方程 适应解

Forward-backward doubly stochastic differential equations under local Lipschitz condition

ZHU Qing-feng<sup>1</sup>,SHI Yu-feng<sup>2</sup>

1. School of Statistics & Mathematics, Shandong University of Finance, Jinan 250014, Shandong, China; 2. School of Mathematics & System Sciences, Shandong University, Jinan 250100, Shandong, China

Abstract:

The existence and uniqueness for the solution of forward-backward doubly stochastic differential equations were obtained under local Lipschitz condition, where the time duration could be arbitrarily given.

Keywords: tochastic analysis forward-backward doubly stochastic differential equations adapted solution

收稿日期 1900-01-01 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: 朱庆峰

作者简介:

本刊中的类似文章

扩展功能

本文信息

Supporting info

PDF(225KB)

[HTML全文](OKB)

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

▶ 随机分析

▶ 正倒向重随机微分方程

▶ 适应解

本文作者相关文章

▶ 朱庆峰

▶ 石玉峰