

论文

正倒向重随机微分方程

(1.山东财政学院 统计与数理学院, 济南 250014, 2.山东大学 数学学院, 济南 250100)

摘要:

该文研究了一类正倒向重随机微分方程, 在某些自然的单调性假设下, 得到了解的存在唯一性结果.

关键词: 正倒向重随机微分方程 等价范数 压缩映像原理

分类号:

60H10

Forward-Backward Doubly Stochastic Differential Equations

(1.Statistics and Mathematics College, Shandong University of Finance, Jinan 250014, 2.School of Mathematics, Shandong University, Jinan 250100)

Abstract:

A type of forward-backward doubly stochastic differential equations (FBDSDEs) is studied. Under some natural monotonicity assumptions, the existence and uniqueness result is established.

Keywords: Forward-backward doubly stochastic differential equations Equivalent norm Contraction mapping

收稿日期 2007-07-14 修回日期 2008-11-20 网络版发布日期 2009-08-25

DOI:

基金项目:

国家自然科学基金(10771122)、山东省自然科学基金(Y2006A08)和国家重点基础研究发展计划(2007CB814900)资助

通讯作者:

作者简介:

参考文献:

[1] Peng S, Shi Y. A type of time-symmetric forward-backward stochastic differential equations. C R Acad Sci Paris, Ser I, 2003, 336(9): 773--778

[2] Pardoux E, Peng S. Backward doubly stochastic differential equations and systems of quasilinear parabolic SPDEs. Probab Theory Relat Fields, 1994, 98: 209--227

[3] Hu Y, Peng S. Solution of forward-backward stochastic differential equations. Probab Theory Relat Fields, 1995, 103: 273--283

扩展功能

本文信息

- ▶ Supporting info
- ▶ PDF(284KB)
- ▶ [HTML全文]
- ▶ 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

- ▶ 正倒向重随机微分方程
- ▶ 等价范数
- ▶ 压缩映像原理

本文作者相关文章

- ▶ 朱庆峰
- ▶ 石玉峰

PubMed

- ▶ Article by Zhu, Q. F.
- ▶ Article by Shi, Y. F.

[4] Feyel D. Sur la m{e}thode de Picard (EDO et EDS). in S{e}minaire de Probabilit{e}s XXI, Lecture Notes in Mathematics, 1247: 515--519

[5] Pardoux E, Tang S. Forward-backward stochastic differential equations and quasilinear parabolic PDEs. Probab Theory Relat Fields, 1999, 114: 123--150

本刊中的类似文章

文章评论 (请注意:本站实行文责自负, 请不要发表与学术无关的内容!评论内容不代表本站观点.)

反馈人	<input type="text"/>	邮箱地址	<input type="text"/>
反馈标题	<input type="text"/>	验证码	<input type="text"/> 8596

Copyright 2008 by 数学物理学报