

论文

带有双障碍的反射倒向随机微分方程的逆比较定理

郑石秋, 周圣武, 徐峰

中国矿业大学理学院, 江苏 徐州 221008

摘要:

讨论了带有双障碍的反射倒向随机微分方程的逆比较问题, 在适当的条件下建立了几个关于其生成元的逆比较定理.

关键词: 反射倒向随机微分方程 生成元 比较定理 逆比较定理

Converse comparison theorems for reflected BSDEs with double obstacles

ZHENG Shi-qiu,ZHOU Sheng-wu,XU Feng

School of Sciences, China University of Mining and Technology, Xuzhou 221008, Jiangsu, China

Abstract:

The converse comparison problem of reflected backward stochastic differential equations (RBSDEs) with double obstacles was explored, and some converse comparison theorems for the generators under some suitable conditions were established.

Keywords: reflected backward stochastic differential equation generator comparison theorem converse comparison theorem

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: 郑石秋

作者简介:

本刊中的类似文章

1. 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

Copyright 2008 by 山东大学学报(理学版)

扩展功能

本文信息

Supporting info

PDF(238KB)

[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

▶ 反射倒向随机微分方程

▶ 生成元

▶ 比较定理

▶ 逆比较定理

本文作者相关文章

▶ 郑石秋

▶ 周圣武

▶ 徐峰