

学术论文

多维带跳倒向双重随机微分方程解的性质

孙晓君, 卢英

东华大学应用数学系

收稿日期 修回日期 网络版发布日期:

摘要 本文研究一类多维带跳倒向双重随机微分方程, 给出了 $It\wedge\{o\}$ 公式在带跳倒向双重随机积分情形下的推广形式, 同时运用推广形式的 $It\wedge\{o\}$ 公式, 在 Lipschitz 条件下证明了方程解的存在性和唯一性.

关键词 [带跳倒向双重随机微分方程](#), [伊藤公式](#), [存在性](#), [唯一性](#).

分类号

The Property for Solutions of the Multi-Dimensional Backward Doubly Stochastic Differential Equations with Jumps

Sun Xiaojun, Lu Ying

Department of Applied Mathematics, Donghua University

Abstract A multi-dimensional backward doubly stochastic differential equations with jumps was studied. The extension of the $It\wedge\{o\}$ formula was given under backward doubly stochastic integral. By the extension of the $It\wedge\{o\}$ formula, the existence and uniqueness of the solutions were obtained under Lipschitz condition.

Key words [Backward doubly stochastic differential equations with jumps](#), [It \$\wedge\{o\}\$ formula](#), [existence](#), [uniqueness](#).

DOI

通讯作者 孙晓君

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(215KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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“带跳倒向双重随机微分方程, 伊藤公式, 存在性, 唯一性.”的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
 - [孙晓君](#)
 - [卢英](#)