

23(6)

Fractional Smoothness of Some Stochastic Integrals

谢鹏, 张希承

湖北武汉华中理工大学数学系

收稿日期 2004-11-30 修回日期 2005-4-26 网络版发布日期 2007-4-12 接受日期 2005-7-27

摘要

关键词 [fractional Sobolev space](#) [stochastic integral](#) [interpolation](#)

分类号 [60H05](#)

Fractional Smoothness of Some Stochastic Integrals

Peng XIE, Xi Cheng ZHANG

Department of Mathematics, Huazhong University of Science and Technology, Wuhan 430074, P. R. China

Abstract We study the fractional smoothness in the sense of Malliavin calculus of stochastic integrals of the form $\int_0^1 p(X_s) dX_s$, where X_s is a semimartingale and p belongs to some fractional Sobolev space over \mathbb{R} .

Key words [fractional Sobolev space](#) [stochastic integral](#) [interpolation](#)

DOI: 10.1007/s10114-005-0859-z

通讯作者 谢鹏 xiepeng@mail.hust.edu.cn

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)
- ▶ [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“fractional Sobolev space”的 相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)

- [谢鹏](#)
- [张希承](#)