

论文

一般g-期望的收敛定理

林乾, 石玉峰

山东大学数学学院, 山东 济南 250100

摘要:

讨论定义在 $I_1(\Omega, F_T, P)$ 空间上一一般g-期望的一些性质,进而得到了一般g-期望的单调收敛定理、Fatou引理和控制收敛定理。

关键词: 倒向随机微分方程 一般g-期望 收敛定理 比较定理

Convergence theorems for generalized g-expectations

LIN Qian, SHI Yu-feng

School of Mathematics and System Science, Shandong University, Jinan 250100, Shandong, China

Abstract:

Some properties of the generalized g-expectations defined in $I_1(\Omega, F_T, P)$ were studied. Also, monotonic convergence theorem, Fatou Lemma, and dominated convergence theorem for the generalized g-expectations were obtained.

Keywords: BSDE generalized g-expectations convergence theorem comparison theorem

收稿日期 2007-11-01 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: 林乾

作者简介:

本刊中的类似文章

1. 张 慧 .不完全信息下推广的递归偏好[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(1): 62-68
2. 王光臣 .部分可观测信息下的线性二次非零和随机微分对策[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(6): 12-15
3. 杨维强,杨 丽 .倒向随机微分方程的非参估计及模拟[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(2): 34-38
4. 韩宝燕,朱 波,石玉峰 .非Lipschitz条件下的倒向随机微分方程的g-上解的极限定理[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(1): 8-13
5. 何 坤 .连续时间完备市场下利用BSDEs考虑套期保值问题[J]. 山东大学学报(理学版), 2008,43(2): 1-07
6. 刘 洁 .g-期望的保常性与 $g(y,0,t)=0$ 的关系[J]. 山东大学学报(理学版), 2008,43(2): 58-61
7. 郑石秋,周圣武,徐 峰 .带有双障碍的反射倒向随机微分方程的逆比较定理[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(10): 63-68
8. 肖 华 .多维反射倒向随机微分方程的解对参数的连续依赖性[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(2): 68-71
9. 杨维强,彭实戈 .期权稳健定价模型及实证[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(2): 69-73
10. 赵国庆 .g-期望下的最优停时问题[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(6): 27-30
11. 何 坤 .倒向随机微分方程解Z的比较定理[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(10): 1-04
12. 杨哲 .推广的倒向随机微分超前方程[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(6): 81-83

扩展功能

本文信息

Supporting info

PDF(OKB)

[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

▶ 倒向随机微分方程

▶ 一般g-期望

▶ 收敛定理

▶ 比较定理

本文作者相关文章

▶ 林乾

▶ 石玉峰

13. 释恒璐,邓 伟,綦 路 .最大数学期望的几个重要性质[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(2): 92-94
14. 释恒璐, .基于g-期望的Holder不等式[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(4): 28-31
15. 任永,秦衍 .非Lipschitz条件下倒向随机微分方程解的稳定性[J]. 山东大学学报(理学版), 2006,41(6): 32-35
16. 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
17. 张 慧,聂秀山 .Knight不确定环境下欧式股票期权的最小定价模型[J]. 山东大学学报(理学版), 2007,42(11): 121-126
18. 黄宗媛 张峰.一类高维抛物型偏微分方程的粘性解[J]. 山东大学学报(理学版), 2008,43(12): 5-9
19. 付静¹,郝涛² .g-期望的一种Kolmogorov不等式[J]. 山东大学学报(理学版), 2009,44(1): 79-83