

[an error  
occurred  
while  
processing  
this  
directive]

本期目录 | 下期目录 | 过刊浏览 | 高级检索

[打印本页]

[关闭]

论文

## $g$ 期望的一种Kolmogorov不等式

付静<sup>1</sup>, 郝涛<sup>2\*</sup>

1. 山东师范大学数科院, 山东 济南 250014; 2. 山东中医药大学理工学院, 山东 济南 250355

摘要:

借助于当生成元 $g$ 满足限制条件时的 $g$  方差比较定理,得到了 $g$  期望的一种Kolmogorov不等式表达形式。结果表明它类似于古典Kolmogorov不等式的形式,推广了古典Kolmogorov不等式。

关键词: 倒向随机微分方程;  $g$ 期望;  $g$ 方差; Kolmogorov不等式

## A Kolmogorov's inequality for $g$ expectation

FU Jing, HAO Tao

1. College of Mathematics and Science, Shandong, Normal University, Jinan 250014, Shandong, China;

2. School of Science and Technology, Shandong University of Traditional Chinese Medicine Shandong, Jinan 250355, Shandong, China

Abstract:

Keywords: backward stochastic differential equation;  $g$  expectation;  $g$  variance; Kolmogorov's inequality

收稿日期 2008-05-13 修回日期 网络版发布日期

DOI:

基金项目:

通讯作者: 郝涛(1981 ),男,助教,硕士,主要从事非线性数学期望与随机分析.Email: haotao-369@163.com

作者简介:

本刊中的类似文章

扩展功能

本文信息

Supporting info

PDF(233KB)

[HTML全文]

[\({article.html\\_WenJianDaXiao}\)](#)  
[KB](#)

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

本文关键词相关文章

倒向随机微分方程;  $g$ 期望;  $g$ 方差; Kolmogorov不等式

本文作者相关文章