

$L^p(\Omega)$ 空间上的Coherent风险度量

陈文财, 叶中行

上海交通大学数学系

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 本文在Banach空间 $L^p(\Omega)$ 上定义Coherent风险度量 $p: L^p(\Omega) \rightarrow R$, 证明了P是下半连续的Coherent风险度量当且仅当存在Banach空间 $L^q(\Omega)$ 中的一个弱闭凸概率测度集Q使得, 其中, 推广了[3]中的部分结果.

关键词 [金融头寸](#) [Lp空间](#) [Coherent风险度量](#) [表示定理](#)

分类号

COHERENT RISK MEASURES DEFINED ON $L^p(\Omega)$ SPACES

Wen Cai CHEN, Zhong Hang YE

Mathematics Department of Shanghai Jiaotong University

Abstract Coherent risk measures are defined on Banach spaces $L_p(\Omega)$ where Ω is a probability space and it is proven that a coherent risk measure $p: L^p(\Omega) \rightarrow R$ is lower partial continuous with respect to the L_p norm, if and only if there exists a unique convex and weak* closed set Q of probability measures lying in the dual space $L^q(\Omega)$ such that $1/p + 1/q = 1$. Some results in [3] are generalized.

Key words [Financial positions](#) [Lp spaces](#) [Coherent risk measures](#) [representation theorem](#)

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(291KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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“金融头寸”的相关文章](#)
- ▶ [本文作者相关文章](#)

- [陈文财](#)
- [叶中行](#)